

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成26年3月7日

【発行者名】 ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役 桐谷 重毅

【本店の所在の場所】 東京都港区六本木六丁目10番1号 六本木ヒルズ森タワー

【事務連絡者氏名】 法務部 山崎 誠吾

【電話番号】 03 - 6437 - 6000

【届出の対象とした募集
（売出）内国投資信託受
益証券に係るファンドの
名称】 ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）
ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）

【届出の対象とした募集
（売出）内国投資信託受
益証券の金額】 それぞれ1兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成25年9月6日付で提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項に変更が生じ、また、本日、半期報告書を提出いたしましたので、原届出書の関係事項を新たな情報により訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

原届出書の該当情報を以下のとおり訂正または更新します。

下線部_____が訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

<訂正前>

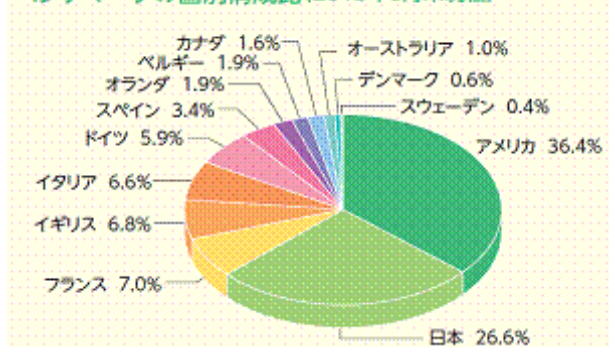
(1) ファンドの目的及び基本的性格

(中略)

<ファンドのベンチマーク>

本ファンドは、世界各国の国債、政府関係機関債、社債を主要投資対象とします。投資対象国を広く分散することにより、特定の国の景気や政治動向、金利動向等の影響を低減することを目指します。

ベンチマークの国別構成比(2013年6月末現在)



・ A コース... J P モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル)(円ヘッジベース)

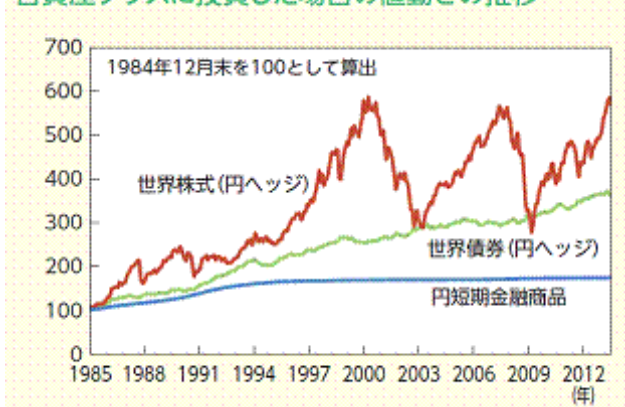
・ B コース... J P モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル)(円ベース)

ベンチマークとは、運用において投資収益目標を設定する際に基準とする指標です。また、投資家がファンドの運用対象や資産の基本配分比率を確認する際の目安となります。

J P モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル)とは、JPモルガンが発表している、世界主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。

<なぜ世界債券投資なのでしょう？>

各資産クラスに投資した場合の値動きの推移



債券への投資は、短期金融商品（預貯金等）を上回る収益を追求することができます。一方で、値下がりリスクがあり、その価格変動幅は、一般に短期金融商品より大きくなりますが株式への投資と比べ小さくなります。

期間：1984年12月末～2013年6月末

出所：ブルームバーグ、JPモルガン、MSCI Inc.

世界株式：MSCIワールド・インデックス(円ヘッジ)

世界債券：J P モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル、円ヘッジ)

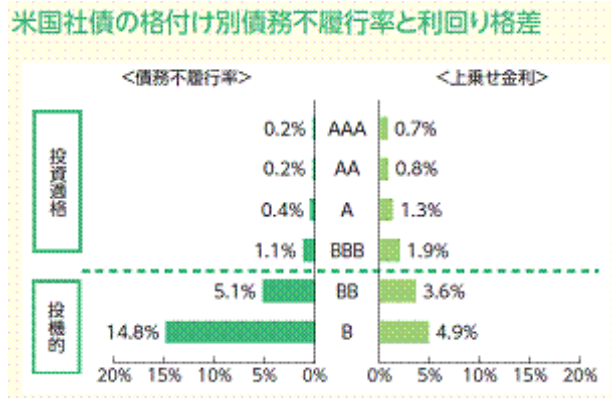
円短期金融商品：1ヵ月円LIBOR

をそれぞれ使用

上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆または保証するものではありません。上記はインデックスのデータであり、本ファンドの実績ではありません。信託報酬等の諸費用や、流動性等の市場要因は考慮されておりませんのでご注意ください。本ファンドの実績は、後記「(参考)運用実績」をご覧ください。Aコースの場合は、為替ヘッジを行う一方でアクティブ通貨運用を行うため一定の為替リスクを伴いますので、上記の円ヘッジのデータとは異なる値動きとなります。また、円ヘッジされていないBコースの場合は為替変動の影響を直接受けるため、値動きは大きくなりますのでご注意ください。

< 高格付け債券への投資 >

(中略)



社債市場では、信用力の高い（格付けが高い）銘柄は、国債に対する上乗せ金利が低くなっていますが、債務不履行が生じる可能性が低く、比較的安定したリターンが期待できます。

< 債務不履行率 >

期間：1981年～2012年

出所：スタンダード＆プアーズ

1981年～2012年の期間について、債務不履行を起こした米国社債の割合を格付け別に算出。なお、該当社債の格付けは、債務不履行時の3年前（各年1月1日時点）の格付けを参照。（2012年12月末現在）

< 上乗せ金利 >

2013年6月末現在

出所：パークレイズ

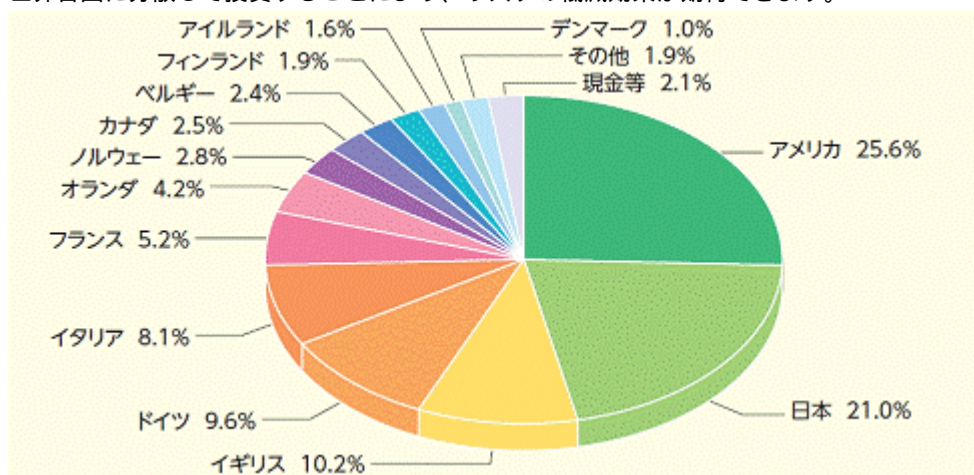
上記は過去のデータであり、将来の債務履行の確実性、将来の利回り水準や米国債との利回り格差（スプレッド）を保証するものではありません。

< Aコース（限定為替ヘッジ）の特徴 >

（中略）

Aコースの債券国別構成比率

世界各国に分散して投資することにより、リスクの低減効果が期待できます。

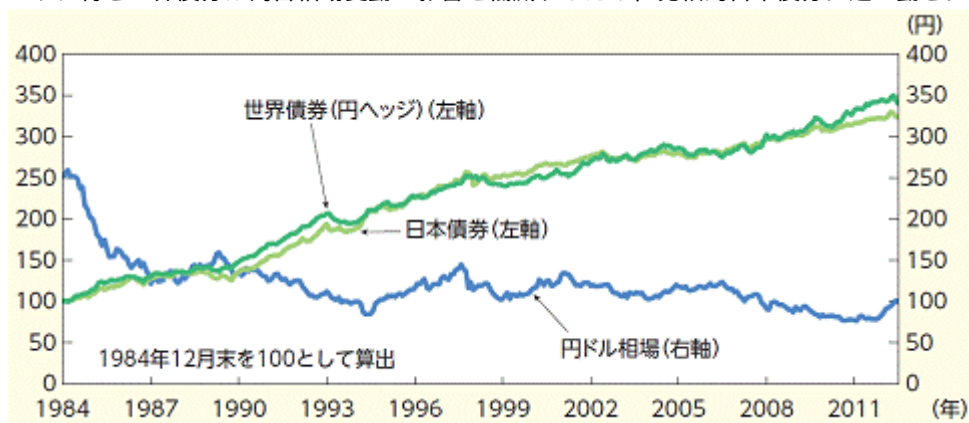


2013年6月末現在

上記はマザーファンドの数値です。また、上記の数値は先物を含みません。

世界債券の値動きの推移と円ドル相場

ヘッジ付き世界債券は為替相場変動の影響を低減するため、比較的日本債券に近い動きになっています。



期間：1984年12月～2013年6月

出所：ブルームバーグ、JPモルガン

世界債券（円ヘッジ）：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス（グローバル、円ヘッジ）

日本債券：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス（日本）

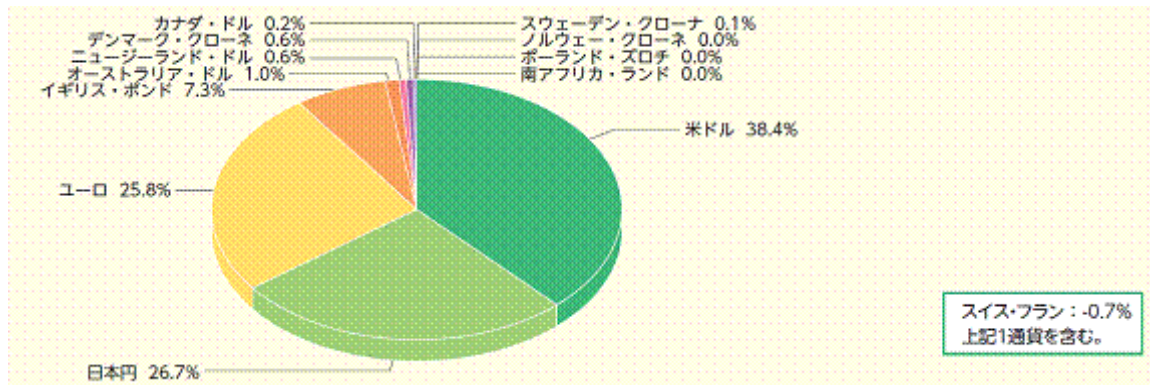
上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆または保証するものではありません。上記はインデックスのデータであり、本ファンドの実績ではありません。信託報酬等の諸費用や、流動性等の市場要因は考慮されておりませんのでご注意ください。

< Bコース（為替ヘッジなし）の特徴 >

（中略）

Bコースの通貨別構成比率

債券の分散効果とともに、通貨の世界分散投資効果も期待できます。

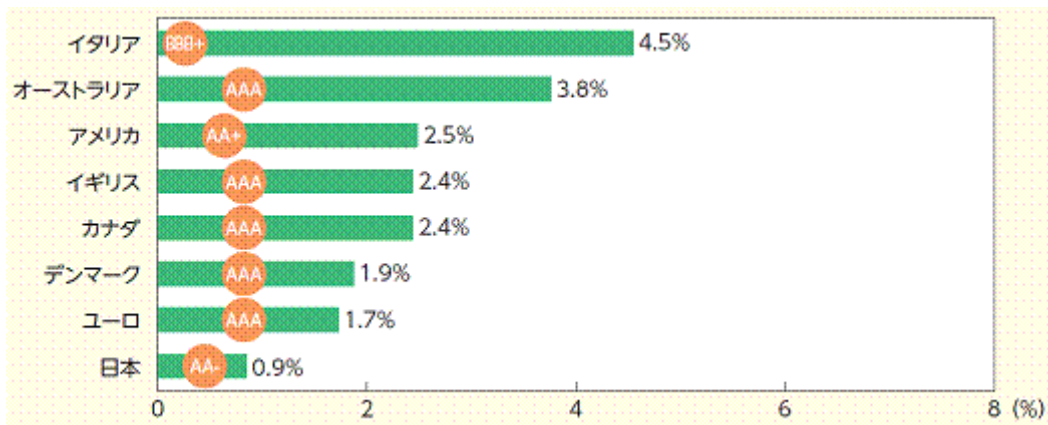


2013年6月末現在

上記はマザーファンドの数値です。

各国の10年国債利回りと格付け

海外金利は国内金利を上回っています。



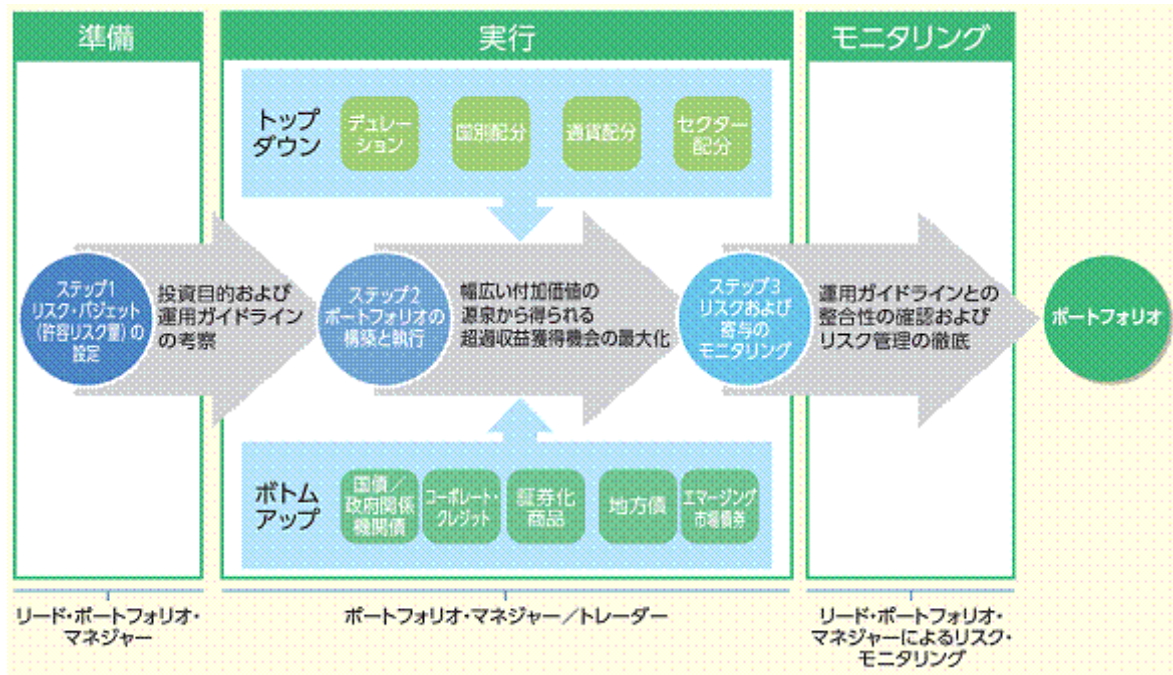
2013年6月末現在

出所：ブルームバーグ、スタンダード＆プアーズ（格付けは自国通貨建て長期債務）

上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆または保証するものではありません。

< ファンドの運用 >

(中略)



本運用プロセスがその目的を達成できる保証はありません。また本運用プロセスは変更される場合があります。

(中略)

(3) ファンドの仕組み

(中略)

2. ファンドの関係法人

委託会社および本ファンドの関係法人の名称および関係業務

(中略)

<ご参考> ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント (GSAM) とは

ゴールドマン・サックスは、1869年（明治2年）創立の世界有数の金融グループのひとつであり、世界の主要都市に拠点を有し、世界中の政府機関・企業・金融機関等に対して、投資銀行業務・証券売買業務・為替商品取引・資産運用業務など、多岐にわたる金融サービスを提供しています。

ゴールドマン・サックスの資産運用グループであるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント (GSAM) は、1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、2012年12月末現在、グループ全体で7,424億米ドル（約64.3兆円^{*}）の資産を運用しています。

* 米ドルの円貨換算は便宜上、2012年12月28日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝86.58円）により、計算しております。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社は、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントの東京拠点です。

(後略)

<訂正後>

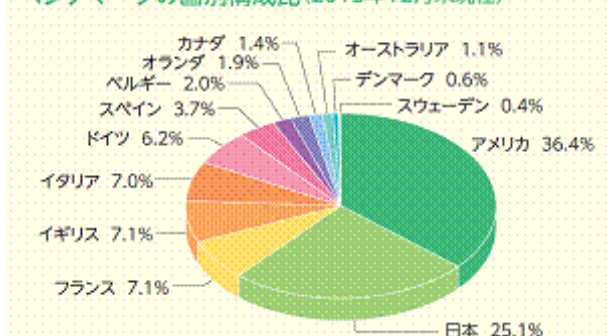
(1) ファンドの目的及び基本的性格

(中略)

<ファンドのベンチマーク>

本ファンドは、世界各国の国債、政府関係機関債、社債を主要投資対象とします。投資対象国を広く分散することにより、特定の国の景気や政治動向、金利動向等の影響を低減することを目指します。

ベンチマークの国別構成比(2013年12月末現在)



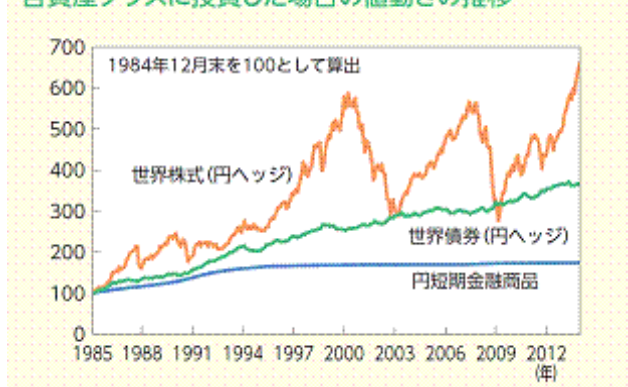
- ・ A コース... J P モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル)(円ヘッジベース)
- ・ B コース... J P モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル)(円ベース)

ベンチマークとは、運用において投資収益目標を設定する際に基準とする指標です。また、投資家がファンドの運用対象や資産の基本配分比率を確認する際の目安となります。

J P モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル)とは、JPモルガンが発表している、世界主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。

<なぜ世界債券投資なのでしょう？>

各資産クラスに投資した場合の値動きの推移



債券への投資は、短期金融商品（預貯金等）を上回る収益を追求することができます。一方で、値下がりリスクがあり、その価格変動幅は、一般に短期金融商品より大きくなりますが株式への投資と比べ小さくなります。

期間：1984年12月末～2013年12月末

出所：ブルームバーグ、JPモルガン、MSCI Inc.

世界株式：MSCIワールド・インデックス(円ヘッジ)

世界債券：J P モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル、円ヘッジ)

円短期金融商品：1ヵ月円LIBOR

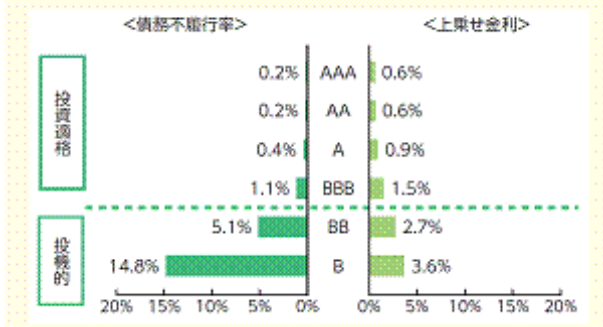
をそれぞれ使用

上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆または保証するものではありません。上記はインデックスのデータであり、本ファンドの実績ではありません。信託報酬等の諸費用や、流動性等の市場要因は考慮されておりませんのでご注意ください。**本ファンドの実績は、後記「5 運用状況（参考）運用実績」をご覧ください。**Aコースの場合は、為替ヘッジを行う一方でアクティブ通貨運用を行うため一定の為替リスクを伴いますので、上記の円ヘッジのデータとは異なる値動きとなります。また、円ヘッジされていないBコースの場合は為替変動の影響を直接受けるため、値動きは大きくなりますのでご注意ください。

< 高格付け債券への投資 >

（中略）

米国社債の格付け別債務不履行率と利回り格差



社債市場では、信用力の高い（格付けが高い）銘柄は、国債に対する上乗せ金利が低くなっていますが、債務不履行が生じる可能性が低く、比較的安定したリターンが期待できます。

< 債務不履行率 >

期間：1981年～2012年

出所：スタンダード＆プアーズ

1981年～2012年の期間について、債務不履行を起こした米国社債の割合を格付け別に算出。なお、該当社債の格付けは、債務不履行時の3年前（各年1月1日時点）の格付けを参照。（2012年12月末現在）

< 上乗せ金利 >

2013年12月末現在

出所：パークレイズ

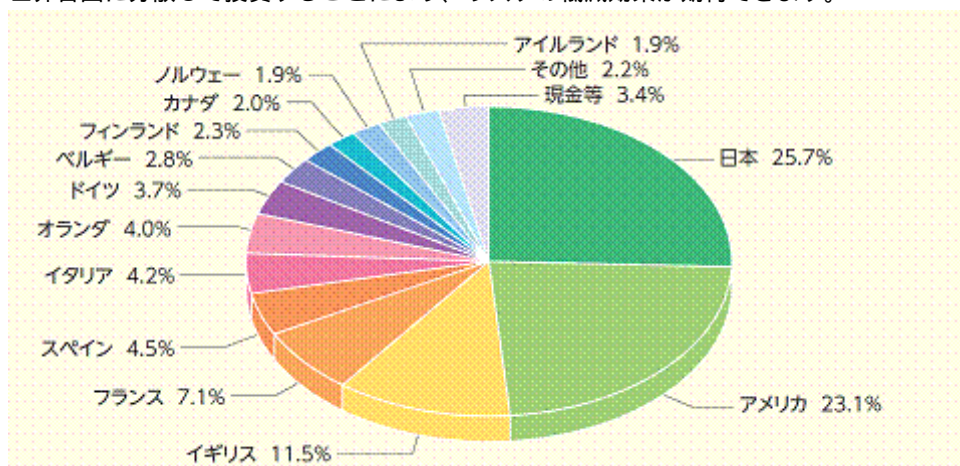
上記は過去のデータであり、将来の債務履行の確実性、将来の利回り水準や米国債との利回り格差（スプレッド）を保証するものではありません。

< Aコース（限定為替ヘッジ）の特徴 >

（中略）

Aコースの債券国別構成比率

世界各国に分散して投資することにより、リスクの低減効果が期待できます。

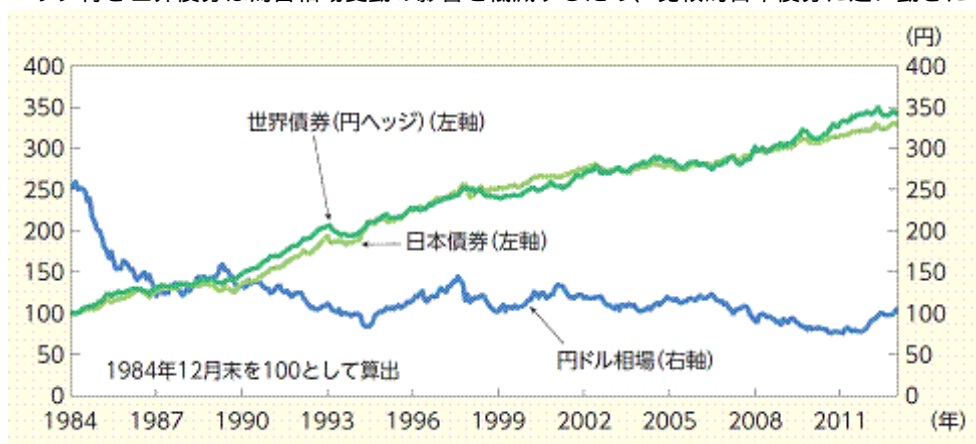


2013年12月末現在

上記はマザーファンドの数値です。また、上記の数値は先物を含みません。

世界債券の値動きの推移と円ドル相場

ヘッジ付き世界債券は為替相場変動の影響を低減するため、比較的日本債券に近い動きになっています。



期間：1984年12月～2013年12月

出所：ブルームバーグ、JPモルガン

世界債券（円ヘッジ）：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス（グローバル、円ヘッジ）

日本債券：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス（日本）

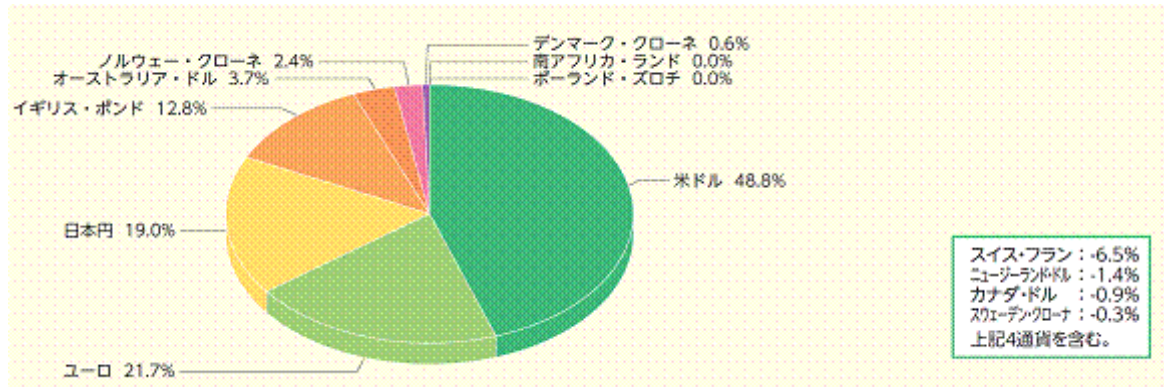
上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆または保証するものではありません。上記はインデックスのデータであり、本ファンドの実績ではありません。信託報酬等の諸費用や、流動性等の市場要因は考慮されておりませんのでご注意ください。**本ファンドの実績は、後記「5 運用状況（参考）運用実績」をご覧ください。**

< Bコース（為替ヘッジなし）の特徴 >

（中略）

Bコースの通貨別構成比率

債券の分散効果とともに、通貨の世界分散投資効果も期待できます。

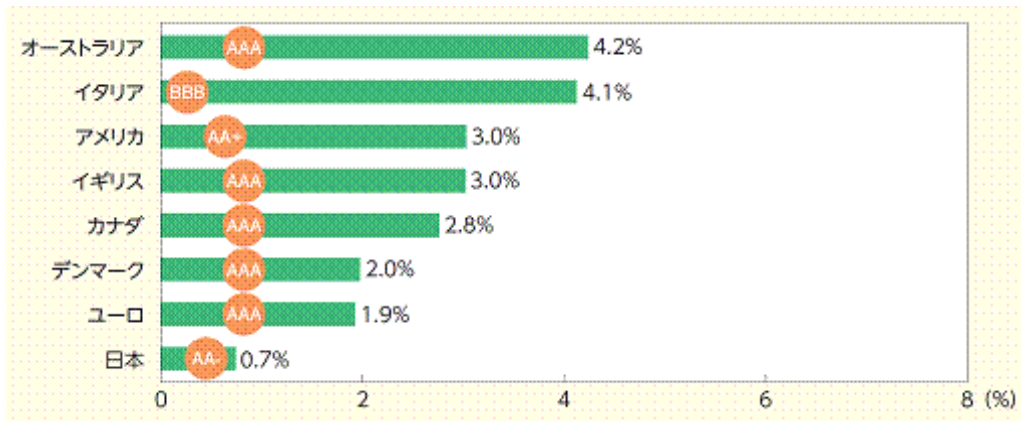


2013年12月末現在

上記はマザーファンドの数値です。

各国の10年国債利回りと格付け

海外金利は国内金利を上回っています。



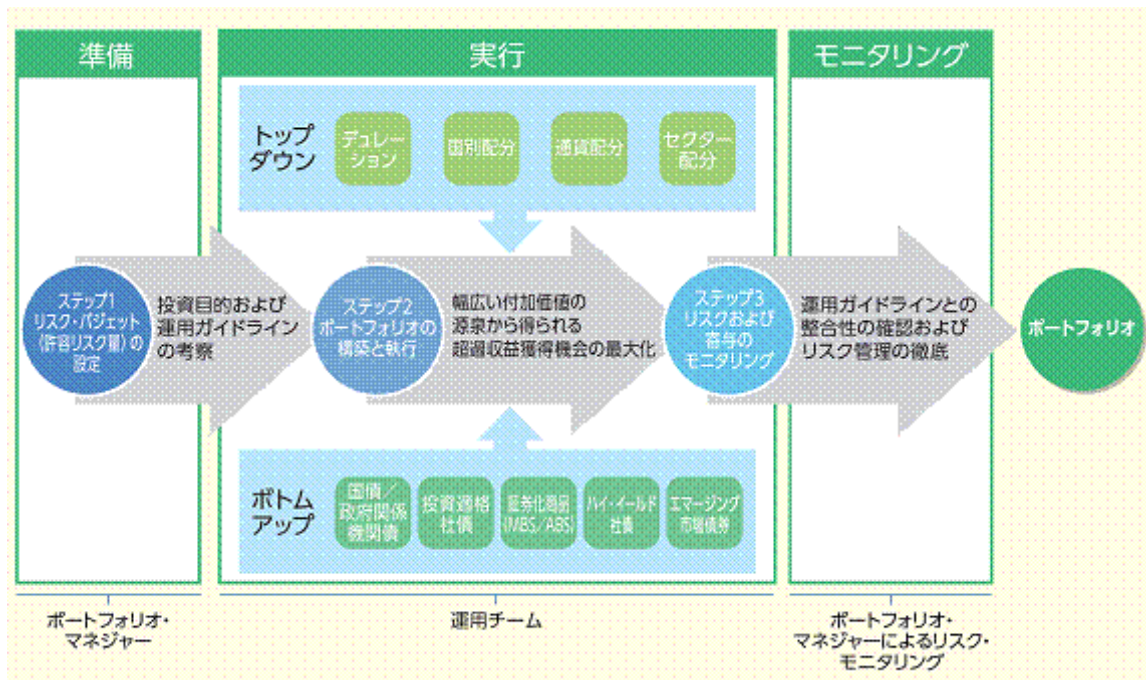
2013年12月末現在

出所：ブルームバーグ、スタンダード＆プアーズ（格付けは自国通貨建て長期債務）

上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆または保証するものではありません。信託報酬等の諸費用は考慮されておりませんのでご注意ください。上記の利回り水準は、将来大きく変動することがあります。

< ファンドの運用 >

(中略)



本運用プロセスがその目的を達成できる保証はありません。また本運用プロセスは変更される場合があります。

(中略)

(3) ファンドの仕組み

(中略)

2. ファンドの関係法人

委託会社および本ファンドの関係法人の名称および関係業務

(中略)

< ご参考 > ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント (GSAM) とは

ゴールドマン・サックスは、1869年（明治2年）創立の世界有数の金融グループのひとつであり、世界の主要都市に拠点を有し、世界中の政府機関・企業・金融機関等に対して、投資銀行業務・証券売買業務・為替商品取引・資産運用業務など、多岐にわたる金融サービスを提供しています。

ゴールドマン・サックスの資産運用グループであるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント (GSAM) は、1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、2013年6月末現在、グループ全体で7,395億米ドル（約72.9兆円^{*}）の資産を運用しています。

* 米ドルの円貨換算は便宜上、2013年6月28日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝98.59円）により、計算しております。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社は、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントの東京拠点です。

(後略)

3 投資リスク

(1) 投資リスク

<訂正前>

(前略)

(a) 元本の変動リスク（本ファンドの投資内容に伴うリスク）

(中略)

(中略)

(中略)

過去の為替相場の推移



期間：1999年1月～2013年6月

出所：ブルームバーグ

上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆または保証するものではありません。

(後略)

<訂正後>

(前略)

(a) 元本の変動リスク（本ファンドの投資内容に伴うリスク）

(中略)

(中略)

(中略)

過去の為替相場の推移



期間：1999年1月～2013年12月

出所：ブルームバーグ

上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆または保証するものではありません。

(後略)

4 手数料等及び税金

(3) 信託報酬等

<訂正前>

以下の支払先が行う本ファンドに関する業務の対価として本ファンドから支払われる信託報酬は、本ファンドの信託財産の計算期間を通じて毎日、本ファンドの信託財産の純資産総額に年率0.9975%（税抜0.95%）を乗じて得た額とします。委託会社、受託銀行および販売会社の配分については、以下のとおりとします。

委託会社	販売会社	受託銀行
年率0.5250%（税込）	年率0.4200%（税込）	年率0.0525%（税込）

（後略）

<訂正後>

以下の支払先が行う本ファンドに関する業務の対価として本ファンドから支払われる信託報酬は、本ファンドの信託財産の計算期間を通じて毎日、本ファンドの信託財産の純資産総額に年率0.9975%（税抜0.95%）を乗じて得た額とします。委託会社、受託銀行および販売会社の配分については、以下のとおりとします。

消費税率が8%になった場合は、年率1.026%（税抜0.95%）となります。なお、下記の配分についても相当分上がります。

委託会社	販売会社	受託銀行
年率0.5250%（税抜0.5%）	年率0.4200%（税抜0.4%）	年率0.0525%（税抜0.05%）

（後略）

5 運用状況

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」については、下記の内容に更新されます。

<訂正・更新後>

(1) 投資状況

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ(確定拠出年金向け)>

(2013年12月30日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		3,575,478,312	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,085,668	0.06
合計(純資産総額)		3,573,392,644	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)>

(2013年12月30日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		6,914,064,509	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,974,222	0.06
合計(純資産総額)		6,910,090,287	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

参考情報

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープンAコース（限定為替ヘッジ）マザーファンド>

（2013年12月30日現在）

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	8,875,646,505	24.95
	アメリカ	2,629,333,542	7.39
	カナダ	696,453,066	1.96
	ドイツ	1,212,994,862	3.41
	イタリア	1,288,748,347	3.62
	フランス	2,041,623,828	5.74
	イギリス	2,763,726,633	7.77
	オランダ	882,131,615	2.48
	スペイン	1,587,272,450	4.46
	ベルギー	1,011,195,317	2.84
	フィンランド	803,024,788	2.26
	デンマーク	300,774,836	0.85
	小計	24,092,925,789	67.72
	特殊債券	アメリカ	1,301,978,294
ドイツ		95,225,243	0.27
国際機関		31,979,176	0.09
小計		1,429,182,713	4.02
社債券	日本	254,095,179	0.71
	アメリカ	4,273,140,917	12.01
	イタリア	196,874,931	0.55
	フランス	492,405,577	1.38
	オーストラリア	314,001,128	0.88
	イギリス	1,322,204,826	3.72
	スイス	39,819,844	0.11
	オランダ	524,258,855	1.47
	スウェーデン	89,159,331	0.25
	ノルウェー	676,091,751	1.90
	アイルランド	667,605,101	1.88
	小計	8,849,657,440	24.87
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,206,185,283	3.39
合計（純資産総額）	-	35,577,951,225	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープンBコース（為替ヘッジなし）マザーファンド>

（2013年12月30日現在）

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	21,320,921,577	21.47
	アメリカ	6,995,225,559	7.04
	カナダ	1,980,220,881	1.99
	ドイツ	7,894,149,986	7.95
	イタリア	2,451,248,462	2.47
	フランス	5,487,795,716	5.53
	イギリス	5,637,433,663	5.68
	オランダ	2,587,360,331	2.61
	スペイン	5,169,378,957	5.21
	ベルギー	3,061,790,415	3.08
	フィンランド	1,755,907,931	1.77
	デンマーク	526,904,823	0.53
	小計	64,868,338,301	65.32
	特殊債券	アメリカ	3,789,560,525
ドイツ		335,889,666	0.34
国際機関		779,444,323	0.78
小計		4,904,894,514	4.94
社債券	日本	656,537,833	0.66
	アメリカ	10,862,890,799	10.94
	イタリア	495,833,161	0.50
	フランス	1,389,718,056	1.40
	オーストラリア	786,828,823	0.79
	イギリス	4,054,690,194	4.08
	スイス	156,252,138	0.16
	オランダ	1,233,001,315	1.24
	スウェーデン	276,393,928	0.28
	ノルウェー	1,914,400,152	1.93
	アイルランド	1,651,120,185	1.66
	小計	23,477,666,584	23.64
	現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	6,054,009,577
合計（純資産総額）	-	99,304,908,976	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(2) 投資資産

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）>

投資有価証券の主要銘柄

(2013年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量 (口数)	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	ゴールドマン・サックス・世界 債券オープンAコース（限定為 替ヘッジ）マザーファンド	2,474,550,704	1.4339	3,548,259,632	1.4449	3,575,478,312	100.06

種類別及び業種別投資比率

(2013年12月30日現在)

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.06
合計	100.06

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資不動産物件（2013年12月30日現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの（2013年12月30日現在）

該当事項はありません。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

投資有価証券の主要銘柄

(2013年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量 (口数)	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	ゴールドマン・サックス・世界 債券オープンBコース（為替 ヘッジなし）マザーファンド	3,482,103,399	1.8397	6,406,259,369	1.9856	6,914,064,509	100.06

種類別及び業種別投資比率

(2013年12月30日現在)

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.06
合計	100.06

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資不動産物件（2013年12月30日現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの（2013年12月30日現在）

該当事項はありません。

参考情報

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープンAコース(限定為替ヘッジ)マザーファンド>

投資有価証券の主要銘柄

(2013年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量 (券面総額)	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第110回利付国債 (5年)	1,776,000,000	100.55	1,785,785,760	100.43	1,783,761,120	0.3	2018/3/20	5.01
2	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 5.4%	8,620,000	15,925.90	1,372,813,391	15,870.93	1,368,074,670	5.4	2023/1/31	3.85
3	日本	国債証券	第310回利付国債 (10年)	1,142,000,000	104.19	1,189,941,160	103.78	1,185,167,600	1	2020/9/20	3.33
4	アメリカ	社債券	JPMCC 2006-CB15 A1A	8,047,366.03	11,517.01	926,816,689	11,491.34	924,750,266	5.81	2043/6/12	2.60
5	日本	国債証券	第89回利付国債 (5年)	910,300,000	100.48	914,724,058	100.44	914,378,144	0.4	2015/6/20	2.57
6	ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4%	4,860,000	17,742.51	862,286,277	17,560.76	853,453,346	4	2037/1/4	2.40
7	イギリス	国債証券	UK TREASURY 2%	4,200,000	17,861.31	750,175,081	17,797.19	747,482,185	2	2016/1/22	2.10
8	イタリア	国債証券	BTPS 4.5%	4,880,000	15,070.98	735,464,129	15,052.13	734,543,952	4.5	2023/5/1	2.06
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1%	6,800,000	10,655.56	724,578,192	10,614.56	721,790,466	1	2016/10/31	2.03
10	フィンランド	国債証券	FINNISH GOV'T 3.125%	4,680,000	14,837.16	694,379,298	14,813.95	693,293,164	3.125	2014/9/15	1.95
11	ベルギー	国債証券	BELGIAN 3.5%	4,280,000	15,899.65	680,505,203	15,831.77	677,599,873	3.5	2017/6/28	1.90
12	イギリス	国債証券	UK TREASURY 4.75%	3,380,000	20,083.52	678,823,262	19,782.22	668,639,273	4.75	2020/3/7	1.88
13	日本	国債証券	第118回利付国債 (20年)	580,100,000	111.56	647,211,769	110.68	642,083,685	2	2030/6/20	1.80
14	日本	国債証券	第96回利付国債 (20年)	558,600,000	115.02	642,507,306	114.05	637,105,644	2.1	2027/6/20	1.79
15	日本	国債証券	第328回利付国債 (10年)	627,500,000	99.95	627,223,900	99.26	622,881,600	0.6	2023/3/20	1.75
16	日本	国債証券	第327回利付国債 (10年)	588,000,000	101.88	599,089,680	101.14	594,703,200	0.8	2022/12/20	1.67
17	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1%	4,000,000	14,541.11	581,644,742	14,461.33	578,453,577	1	2018/5/25	1.63
18	日本	国債証券	第280回利付国債 (10年)	554,150,000	104.53	579,252,995	104.38	578,449,477	1.9	2016/6/20	1.63
19	オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVT 4.5%	3,430,000	16,470.86	564,950,593	16,396.45	562,398,347	4.5	2017/7/15	1.58
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.75%	5,320,000	10,376.17	552,012,384	10,301.66	548,048,408	0.75	2017/12/31	1.54
21	アメリカ	社債券	CSMC 2007-C1 A1A	4,109,835.08	11,161.85	458,733,827	11,237.28	461,833,778	5.361	2040/2/15	1.30
22	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5%	2,560,000	17,665.05	452,225,497	17,452.56	446,785,557	4.5	2041/4/25	1.26
23	カナダ	国債証券	CANADA-GOV'T 8%	2,650,000	15,371.72	407,350,784	15,252.63	404,194,946	8	2027/6/1	1.14
24	イギリス	国債証券	UK TREASURY 3.75%	2,260,000	18,000.31	406,807,224	17,653.49	398,968,980	3.75	2052/7/22	1.12
25	イギリス	国債証券	UK TREASURY 4.5%	1,910,000	19,889.43	379,888,259	19,597.87	374,319,333	4.5	2034/9/7	1.05
26	アメリカ	特殊債券	FHMS K030 A2	3,600,000	10,468.49	376,865,939	10,384.69	373,848,880	3.25	2023/4/25	1.05
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 4.375%	3,190,000	11,521.55	367,537,468	11,451.15	365,291,695	4.375	2039/11/15	1.03
28	日本	国債証券	第27回利付国債 (30年)	307,700,000	117.11	360,359,778	116.16	357,436,628	2.5	2037/9/20	1.00
29	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.25%	2,420,000	14,658.31	354,731,315	14,512.97	351,214,061	2.25	2022/10/25	0.99
30	イギリス	国債証券	UK TREASURY 4.25%	1,800,000	19,381.71	348,870,806	19,055.56	343,000,154	4.25	2040/12/7	0.96

種類別及び業種別投資比率

(2013年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	67.72
特殊債券	4.02
社債券	24.87
合計	96.61

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資不動産物件(2013年12月30日現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
有価証券先物取引等

(2013年12月30日現在)

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	評価額金額	評価額金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	日本	東京証券取引所	東証長期国債標準物先物	売建	200,000,000	日本円	287,939,200	286,640,000	286,640,000	0.81
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 10Y 1403	売建	185	米ドル	22,980,468.75	22,752,110.3	2,397,844,904	6.74
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 2Y 1403	買建	33	米ドル	7,264,640.46	7,252,781.58	764,370,650	2.15
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 20Y 1403	売建	125	米ドル	16,113,281.25	16,035,156.25	1,689,945,117	4.75
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 30Y 1403	買建	57	米ドル	7,792,968.75	7,766,250	818,485,087	2.30
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 5Y 1403	売建	265	米ドル	31,838,583.4	31,605,391.95	3,330,892,257	9.36
	カナダ	モントリオール取引所	MON 10Y 1403	買建	60	カナダドル	7,638,600	7,591,800	747,184,956	2.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BOBL 1403	買建	62	ユーロ	7,745,123.7	7,702,260	1,117,212,813	3.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BTP 1403	買建	84	ユーロ	9,584,884.8	9,565,080	1,387,414,854	3.90
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1403	売建	123	ユーロ	17,237,542.8	17,092,080	2,479,206,204	6.97
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	OAT 1403	売建	18	ユーロ	2,382,300	2,364,480	342,967,824	0.96
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SCHATZ 1403	買建	46	ユーロ	5,075,870	5,071,040	735,554,352	2.07
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE10Y 1403	買建	11	オーストラリアドル	1,251,686.81	1,257,428.7	117,242,651	0.33
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE3Y 1403	買建	135	オーストラリアドル	14,623,795.35	14,637,523.5	1,364,802,691	3.84
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT 1403	売建	65	英ポンド	7,000,338.8	6,895,200	1,198,109,952	3.37
その他先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	売建	31	米ドル	7,722,487.5	7,717,062.5	813,301,216	2.29
	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	売建	31	米ドル	7,715,512.5	7,708,925	812,443,605	2.28
	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	売建	31	米ドル	7,705,437.5	7,697,300	811,218,447	2.28
	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	売建	31	米ドル	7,691,487.5	7,681,800	809,584,902	2.28
	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	売建	204	米ドル	50,359,950	50,260,500	5,296,954,095	14.89
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3M EURIBOR	買建	25	ユーロ	6,227,812.5	6,227,812.5	903,344,203	2.54
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3M EURIBOR	買建	26	ユーロ	6,474,000	6,472,050	938,770,852	2.64
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3M EURIBOR	買建	25	ユーロ	6,220,625	6,216,875	901,757,718	2.53
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3M EURIBOR	買建	25	ユーロ	6,215,312.5	6,210,000	900,760,500	2.53

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価比率をいいます。

(注2) 評価額は、計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープンBコース(為替ヘッジなし)マザーファンド>

投資有価証券の主要銘柄

(2013年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量 (券面総額)	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	ドイツ	国債証券	BUNDESSCHATZANW 0%	40,500,000	14,487.30	5,867,357,983	14,485.27	5,866,535,550	0	2014/12/12	5.91
2	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 5.4%	26,880,000	15,925.90	4,280,884,467	15,870.93	4,266,107,556	5.4	2023/1/31	4.30
3	日本	国債証券	第110回利付国債 (5年)	4,228,000,000	100.55	4,251,296,280	100.43	4,246,476,360	0.3	2018/3/20	4.28
4	日本	国債証券	第310回利付国債 (10年)	3,091,700,000	104.19	3,221,489,566	103.78	3,208,566,260	1	2020/9/20	3.23
5	イギリス	国債証券	UK TREASURY 2%	15,470,000	17,861.31	2,763,144,889	17,797.19	2,753,226,054	2	2016/1/22	2.77
6	オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVT 4.5%	15,780,000	16,470.86	2,599,102,147	16,396.45	2,587,360,331	4.5	2017/7/15	2.61
7	日本	国債証券	第328回利付国債 (10年)	2,275,000,000	99.95	2,273,999,000	99.26	2,258,256,000	0.6	2023/3/20	2.27
8	アメリカ	社債券	JPMCC 2006-CB15 A1A	17,262,068.02	11,517.01	1,988,075,687	11,491.34	1,983,643,086	5.81	2043/6/12	2.00
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.375%	18,100,000	10,546.79	1,908,970,402	10,532.36	1,906,357,160	0.375	2016/1/15	1.92
10	ベルギー	国債証券	BELGIAN 3.5%	11,250,000	15,899.65	1,788,711,107	15,831.77	1,781,074,437	3.5	2017/6/28	1.79
11	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1%	11,800,000	14,541.11	1,715,851,992	14,461.33	1,706,438,067	1	2018/5/25	1.72
12	フィンランド	国債証券	FINNISH GOV'T 3.125%	10,930,000	14,837.16	1,621,702,079	14,813.95	1,619,165,445	3.125	2014/9/15	1.63
13	日本	国債証券	第92回利付国債 (20年)	1,400,000,000	115.26	1,613,724,000	114.18	1,598,562,000	2.1	2026/12/20	1.61
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1%	14,670,000	10,655.56	1,563,170,894	10,614.56	1,557,156,785	1	2016/10/31	1.57
15	ドイツ	国債証券	BUNDESABL 0.5%	10,090,000	14,430.58	1,456,046,456	14,360.52	1,448,977,463	0.5	2018/2/23	1.46
16	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.25%	8,530,000	14,658.31	1,250,354,598	14,512.97	1,237,957,002	2.25	2022/10/25	1.25
17	日本	国債証券	第327回利付国債 (10年)	1,197,000,000	101.88	1,219,575,420	101.14	1,210,645,800	0.8	2022/12/20	1.22
18	アメリカ	社債券	CSMC 2007-C1 A1A	10,158,271.63	11,161.85	1,133,851,539	11,237.28	1,141,513,682	5.361	2040/2/15	1.15
19	カナダ	国債証券	CANADA-GOV'T 2.5%	10,860,000	10,055.47	1,092,024,365	10,042.28	1,090,592,118	2.5	2015/6/1	1.10
20	イタリア	国債証券	BTPS 4.5%	7,160,000	15,070.98	1,079,082,615	15,052.13	1,077,732,520	4.5	2023/5/1	1.09
21	日本	国債証券	第140回利付国債 (20年)	1,024,000,000	104.15	1,066,496,000	103.44	1,059,317,760	1.7	2032/9/20	1.07
22	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5%	5,910,000	17,665.05	1,044,004,961	17,452.56	1,031,446,347	4.5	2041/4/25	1.04
23	アメリカ	特殊債券	FHMS K030 A2	9,800,000	10,468.49	1,025,912,833	10,384.69	1,017,699,730	3.25	2023/4/25	1.02
24	イギリス	国債証券	UK TREASURY 3.75%	5,760,000	18,000.31	1,036,818,429	17,653.49	1,016,841,295	3.75	2052/7/22	1.02
25	イタリア	国債証券	BTPS 6%	5,400,000	16,745.87	904,277,357	16,761.39	905,115,481	6	2031/5/1	0.91
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875%	8,580,000	10,597.70	909,282,778	10,539.73	904,309,596	3.875	2040/8/15	0.91
27	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 4.4%	6,140,000	14,835.12	910,876,577	14,711.26	903,271,401	4.4	2023/10/31	0.91
28	日本	国債証券	第89回利付国債 (5年)	883,000,000	100.48	887,291,380	100.44	886,955,840	0.4	2015/6/20	0.89
29	日本	国債証券	第125回利付国債 (20年)	770,000,000	113.81	876,390,900	112.96	869,845,900	2.2	2031/3/20	0.88
30	イギリス	国債証券	UK TREASURY 4.5%	4,360,000	19,889.43	867,179,482	19,597.87	854,467,168	4.5	2034/9/7	0.86

種類別及び業種別投資比率

(2013年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	65.32
特殊債券	4.94
社債券	23.64
合計	93.90

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資不動産物件(2013年12月30日現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
有価証券先物取引等

(2013年12月30日現在)

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	評価額金額	評価額金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 10Y 1403	売建	280	米ドル	34,781,250	34,435,626.4	3,629,170,666	3.65
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 2Y 1403	買建	182	米ドル	40,065,592.84	40,000,189.32	4,215,619,952	4.25
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 20Y 1403	売建	555	米ドル	71,542,968.75	71,196,093.75	7,503,356,320	7.56
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 30Y 1403	買建	291	米ドル	39,785,156.25	39,648,750	4,178,581,762	4.21
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 5Y 1403	売建	899	米ドル	108,018,180.4	107,219,801.37	11,299,894,866	11.38
	カナダ	モントリオール取引所	MON 10Y 1403	買建	150	カナダドル	19,096,500	18,979,500	1,867,962,390	1.88
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BOBL 1403	買建	42	ユーロ	5,252,520	5,217,660	756,821,583	0.76
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BTP 1403	買建	230	ユーロ	26,121,961.6	26,190,100	3,798,874,005	3.83
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1403	売建	205	ユーロ	28,723,733.8	28,486,800	4,132,010,340	4.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUXL 1403	買建	72	ユーロ	8,837,280	8,763,840	1,271,194,992	1.28
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	OAT 1403	買建	2	ユーロ	264,700	262,720	38,107,536	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SCHATZ 1403	買建	155	ユーロ	17,103,475	17,087,200	2,478,498,360	2.50
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE10Y 1403	買建	11	オーストラリアドル	1,251,686.81	1,257,428.7	117,242,651	0.12
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE3Y 1403	買建	369	オーストラリアドル	39,971,707.29	40,009,230.9	3,730,460,689	3.76
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT 1403	売建	76	英ポンド	8,185,200	8,062,080	1,400,867,020	1.41
その他先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	売建	79	米ドル	19,679,887.5	19,666,062.5	2,072,606,326	2.09
	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	売建	79	米ドル	19,662,112.5	19,645,325	2,070,420,801	2.08
	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	売建	79	米ドル	19,636,437.5	19,615,700	2,067,298,623	2.08
	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	売建	79	米ドル	19,600,887.5	19,576,200	2,063,135,718	2.08
	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	売建	511	米ドル	126,146,737.5	125,897,625	13,268,350,698	13.36
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3M EURIBOR	買建	44	ユーロ	10,960,950	10,960,950	1,589,885,797	1.60
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3M EURIBOR	買建	47	ユーロ	11,703,000	11,699,475	1,697,008,848	1.71
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3M EURIBOR	買建	44	ユーロ	10,948,300	10,941,700	1,587,093,585	1.60
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3M EURIBOR	買建	44	ユーロ	10,938,950	10,929,600	1,585,338,480	1.60

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価比率をいいます。

(注2) 評価額は、計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

(3) 運用実績

純資産の推移

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ(確定拠出年金向け)>

2013年12月30日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期末の純資産の推移は次の通りです。

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第3期	(2004年6月7日)	658	658	1.0472	1.0472
第4期	(2005年6月7日)	895	895	1.0939	1.0939
第5期	(2006年6月7日)	871	871	1.0510	1.0510
第6期	(2007年6月7日)	955	955	1.0294	1.0294
第7期	(2008年6月9日)	1,099	1,099	1.0247	1.0247
第8期	(2009年6月8日)	1,924	1,924	1.0549	1.0549
第9期	(2010年6月7日)	2,577	2,577	1.1605	1.1605
第10期	(2011年6月7日)	2,822	2,822	1.1626	1.1626
第11期	(2012年6月7日)	3,435	3,435	1.2367	1.2367
第12期	(2013年6月7日)	3,585	3,585	1.2727	1.2727
	2012年12月末日	3,668	-	1.2642	-
	2013年1月末日	3,620	-	1.2579	-
	2013年2月末日	3,648	-	1.2664	-
	2013年3月末日	3,670	-	1.2736	-
	2013年4月末日	3,675	-	1.2909	-
	2013年5月末日	3,614	-	1.2762	-
	2013年6月末日	3,558	-	1.2579	-
	2013年7月末日	3,564	-	1.2585	-
	2013年8月末日	3,599	-	1.2534	-
	2013年9月末日	3,600	-	1.2596	-
	2013年10月末日	3,612	-	1.2700	-
	2013年11月末日	3,593	-	1.2731	-
	2013年12月末日	3,573	-	1.2679	-

(注) 表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)>

2013年12月30日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期末の純資産の推移は次の通りです。

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第3期	(2004年6月7日)	321	321	1.1760	1.1760
第4期	(2005年6月7日)	582	582	1.2179	1.2179
第5期	(2006年6月7日)	779	779	1.2693	1.2693
第6期	(2007年6月7日)	1,176	1,176	1.3711	1.3711
第7期	(2008年6月9日)	1,833	1,833	1.3609	1.3609
第8期	(2009年6月8日)	3,850	3,850	1.2855	1.2855
第9期	(2010年6月7日)	4,481	4,481	1.2673	1.2673
第10期	(2011年6月7日)	5,085	5,085	1.2551	1.2551
第11期	(2012年6月7日)	5,426	5,426	1.2719	1.2719
第12期	(2013年6月7日)	6,563	6,563	1.5387	1.5387
	2012年12月末日	6,143	-	1.4111	-
	2013年1月末日	6,388	-	1.4648	-
	2013年2月末日	6,386	-	1.4747	-
	2013年3月末日	6,439	-	1.4917	-
	2013年4月末日	6,699	-	1.5628	-
	2013年5月末日	6,748	-	1.5784	-
	2013年6月末日	6,532	-	1.5230	-
	2013年7月末日	6,494	-	1.5258	-
	2013年8月末日	6,496	-	1.5241	-
	2013年9月末日	6,554	-	1.5382	-
	2013年10月末日	6,620	-	1.5667	-
	2013年11月末日	6,796	-	1.6136	-
	2013年12月末日	6,910	-	1.6483	-

(注) 表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

分配の推移

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）>

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第3期	自 2003年6月10日 至 2004年6月7日	0.0000
第4期	自 2004年6月8日 至 2005年6月7日	0.0000
第5期	自 2005年6月8日 至 2006年6月7日	0.0000
第6期	自 2006年6月8日 至 2007年6月7日	0.0000
第7期	自 2007年6月8日 至 2008年6月9日	0.0000
第8期	自 2008年6月10日 至 2009年6月8日	0.0000
第9期	自 2009年6月9日 至 2010年6月7日	0.0000
第10期	自 2010年6月8日 至 2011年6月7日	0.0000
第11期	自 2011年6月8日 至 2012年6月7日	0.0000
第12期	自 2012年6月8日 至 2013年6月7日	0.0000

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第3期	自 2003年6月10日 至 2004年6月7日	0.0000
第4期	自 2004年6月8日 至 2005年6月7日	0.0000
第5期	自 2005年6月8日 至 2006年6月7日	0.0000
第6期	自 2006年6月8日 至 2007年6月7日	0.0000
第7期	自 2007年6月8日 至 2008年6月9日	0.0000
第8期	自 2008年6月10日 至 2009年6月8日	0.0000
第9期	自 2009年6月9日 至 2010年6月7日	0.0000
第10期	自 2010年6月8日 至 2011年6月7日	0.0000
第11期	自 2011年6月8日 至 2012年6月7日	0.0000
第12期	自 2012年6月8日 至 2013年6月7日	0.0000

収益率の推移

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）>

期	計算期間	収益率（％）
第3期	自 2003年6月10日 至 2004年6月7日	2.8
第4期	自 2004年6月8日 至 2005年6月7日	4.5
第5期	自 2005年6月8日 至 2006年6月7日	3.9
第6期	自 2006年6月8日 至 2007年6月7日	2.1
第7期	自 2007年6月8日 至 2008年6月9日	0.5
第8期	自 2008年6月10日 至 2009年6月8日	2.9
第9期	自 2009年6月9日 至 2010年6月7日	10.0
第10期	自 2010年6月8日 至 2011年6月7日	0.2
第11期	自 2011年6月8日 至 2012年6月7日	6.4
第12期	自 2012年6月8日 至 2013年6月7日	2.9
第13期 (中間期)	自 2013年6月8日 至 2013年12月7日	0.5

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

期	計算期間	収益率（％）
第3期	自 2003年6月10日 至 2004年6月7日	3.5
第4期	自 2004年6月8日 至 2005年6月7日	3.6
第5期	自 2005年6月8日 至 2006年6月7日	4.2
第6期	自 2006年6月8日 至 2007年6月7日	8.0
第7期	自 2007年6月8日 至 2008年6月9日	0.7
第8期	自 2008年6月10日 至 2009年6月8日	5.5
第9期	自 2009年6月9日 至 2010年6月7日	1.4
第10期	自 2010年6月8日 至 2011年6月7日	1.0
第11期	自 2011年6月8日 至 2012年6月7日	1.3
第12期	自 2012年6月8日 至 2013年6月7日	21.0
第13期 (中間期)	自 2013年6月8日 至 2013年12月7日	4.1

(4) 設定及び解約の実績

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）>

下記計算期間中の設定及び解約の実績ならびに当該計算期末の発行済み口数は次の通りです。

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期	自 2003年6月10日 至 2004年6月7日	217,441,930 (0)	66,772,021 (0)	628,433,284 (0)
第4期	自 2004年6月8日 至 2005年6月7日	254,260,996 (0)	63,780,306 (0)	818,913,974 (0)
第5期	自 2005年6月8日 至 2006年6月7日	200,751,068 (0)	190,195,039 (0)	829,470,003 (0)
第6期	自 2006年6月8日 至 2007年6月7日	277,164,674 (0)	178,433,512 (0)	928,201,165 (0)
第7期	自 2007年6月8日 至 2008年6月9日	496,012,940 (0)	350,984,719 (0)	1,073,229,386 (0)
第8期	自 2008年6月10日 至 2009年6月8日	1,021,056,268 (0)	270,328,802 (0)	1,823,956,852 (0)
第9期	自 2009年6月9日 至 2010年6月7日	682,944,551 (0)	285,880,298 (0)	2,221,021,105 (0)
第10期	自 2010年6月8日 至 2011年6月7日	722,231,350 (0)	515,326,184 (0)	2,427,926,271 (0)
第11期	自 2011年6月8日 至 2012年6月7日	722,570,328 (0)	372,391,917 (0)	2,778,104,682 (0)
第12期	自 2012年6月8日 至 2013年6月7日	717,680,971 (0)	678,187,314 (0)	2,817,598,339 (0)
第13期 (中間期)	自 2013年6月8日 至 2013年12月7日	246,330,151 (0)	245,861,815 (0)	2,818,066,675 (0)

(注) ()内の数字は本邦外における設定、解約及び発行済み口数です。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

下記計算期間中の設定及び解約の実績ならびに当該計算期末の発行済み口数は次の通りです。

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期	自 2003年6月10日 至 2004年6月7日	222,864,561 (0)	41,336,197 (0)	273,437,035 (0)
第4期	自 2004年6月8日 至 2005年6月7日	259,131,022 (0)	53,927,339 (0)	478,640,718 (0)
第5期	自 2005年6月8日 至 2006年6月7日	298,892,479 (0)	163,182,842 (0)	614,350,355 (0)
第6期	自 2006年6月8日 至 2007年6月7日	381,703,113 (0)	137,702,548 (0)	858,350,920 (0)
第7期	自 2007年6月8日 至 2008年6月9日	679,981,878 (0)	190,710,301 (0)	1,347,622,497 (0)
第8期	自 2008年6月10日 至 2009年6月8日	1,946,217,360 (0)	298,301,344 (0)	2,995,538,513 (0)
第9期	自 2009年6月9日 至 2010年6月7日	852,071,919 (0)	311,749,460 (0)	3,535,860,972 (0)
第10期	自 2010年6月8日 至 2011年6月7日	816,154,634 (0)	300,416,157 (0)	4,051,599,449 (0)
第11期	自 2011年6月8日 至 2012年6月7日	574,535,606 (0)	359,192,597 (0)	4,266,942,458 (0)
第12期	自 2012年6月8日 至 2013年6月7日	571,990,984 (0)	573,581,655 (0)	4,265,351,787 (0)
第13期 (中間期)	自 2013年6月8日 至 2013年12月7日	254,030,739 (0)	324,132,555 (0)	4,195,249,971 (0)

(注) ()内の数字は本邦外における設定、解約及び発行済み口数です。

(参考) 運用実績

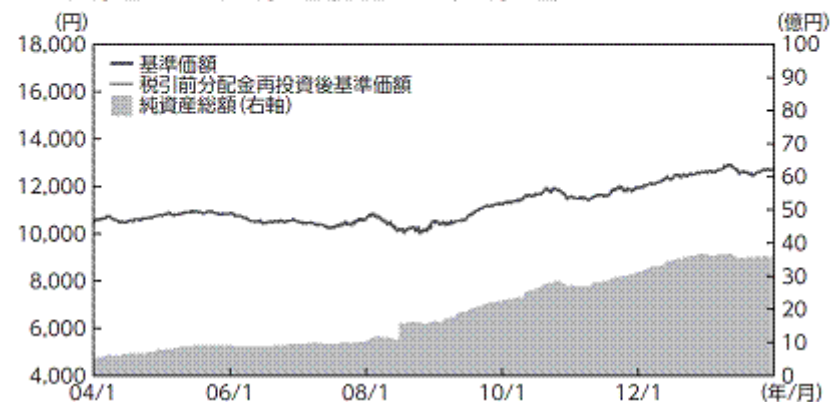
下記は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

2013年12月30日現在

Aコース(限定為替ヘッジ)

基準価額・純資産の推移

2004年1月5日～2013年12月30日(設定日:2001年11月22日)



基準価額・純資産総額

基準価額	12,679円
純資産総額	35.7億円

期間別騰落率
(税引前分配金再投資)

期間	ファンド
1ヵ月	-0.41%
3ヵ月	0.66%
6ヵ月	0.79%
1年	0.29%
3年	9.80%
5年	20.04%
設定来	26.79%

●税引前分配金再投資後基準価額および期間別騰落率(税引前分配金再投資)とは、本ファンドの決算時に収益の分配があった場合に、その分配金(税引前)で本ファンドを購入(再投資)した場合の基準価額および騰落率です。●運用状況によっては、分配金の金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

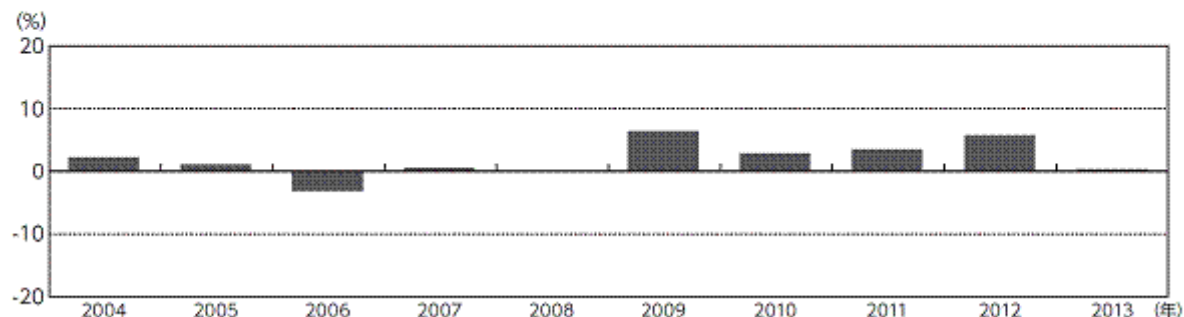
決算日	09/6/8	10/6/7	11/6/7	12/6/7	13/6/7	設定来累計
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円

主要な資産の状況

	銘柄名	通貨	残存年数	構成比
1	第110回利付国債(5年) 0.3% 2018年3月20日	JPY	4.2年	5.0%
2	スペイン国債 5.4% 2023年1月31日	EUR	9.1年	3.8%
3	第310回利付国債(10年) 1% 2020年9月20日	JPY	6.7年	3.3%
4	JPモルガン・チェース 5.81% 2043年6月12日	USD	29.5年	2.6%
5	第89回利付国債(5年) 0.4% 2015年6月20日	JPY	1.5年	2.6%
6	ドイツ国債 4% 2037年1月4日	EUR	23.0年	2.4%
7	イギリス国債 2% 2016年1月22日	GBP	2.1年	2.1%
8	イタリア国債 4.5% 2023年5月1日	EUR	9.3年	2.1%
9	アメリカ国債 1% 2016年10月31日	USD	2.8年	2.0%
10	フィンランド国債 3.125% 2014年9月15日	EUR	0.7年	1.9%

●債券現物のみ(先物を除く)の数値です。

年間収益率の推移



●本ファンドの収益率は、分配金(税引前)を再投資したものととして算出しています。

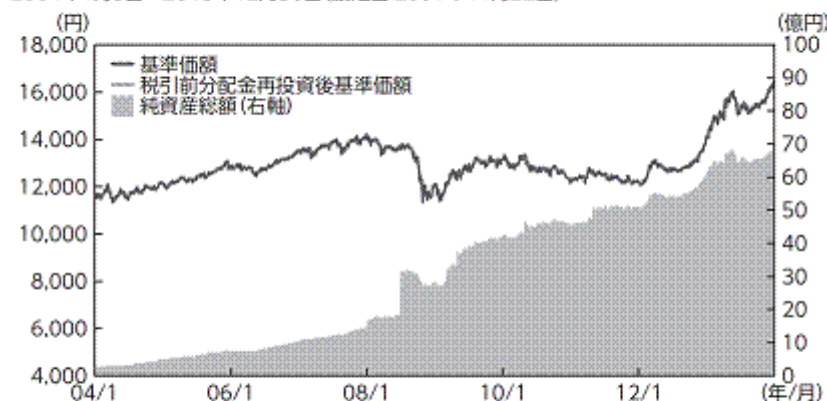
下記は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

2013年12月30日現在

Bコース(為替ヘッジなし)

基準価額・純資産の推移

2004年1月5日～2013年12月30日(設定日:2001年11月22日)



基準価額・純資産総額

基準価額	16,483円
純資産総額	69.1億円

期間別騰落率 (税引前分配金再投資)

期間	ファンド
1ヵ月	2.15%
3ヵ月	7.16%
6ヵ月	8.23%
1年	16.81%
3年	35.66%
5年	36.10%
設定来	64.83%

●税引前分配金再投資後基準価額および期間別騰落率(税引前分配金再投資)とは、本ファンドの決算時に収益の分配があった場合に、その分配金(税引前)で本ファンドを購入(再投資)した場合の基準価額および騰落率です。●運用状況によっては、分配金の金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

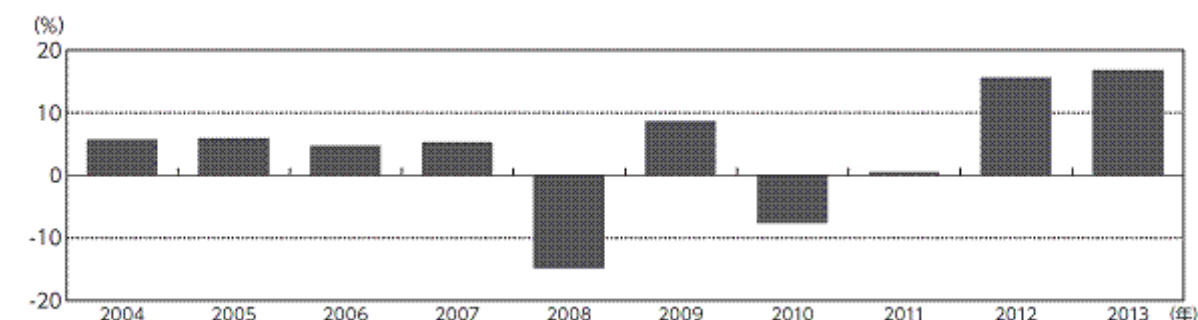
決算日	09/6/8	10/6/7	11/6/7	12/6/7	13/6/7	設定来累計
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円

主要な資産の状況

	銘柄名	通貨	残存年数	構成比
1	ドイツ国債 0% 2014年12月12日	EUR	1.0年	5.9%
2	スペイン国債 5.4% 2023年1月31日	EUR	9.1年	4.3%
3	第110回利付国債(5年) 0.3% 2018年3月20日	JPY	4.2年	4.3%
4	第310回利付国債(10年) 1% 2020年9月20日	JPY	6.7年	3.2%
5	イギリス国債 2% 2016年1月22日	GBP	2.1年	2.8%
6	オランダ国債 4.5% 2017年7月15日	EUR	3.5年	2.6%
7	第328回利付国債(10年) 0.6% 2023年3月20日	JPY	9.2年	2.3%
8	JPモルガン・チェース 5.81% 2043年6月12日	USD	29.5年	2.0%
9	アメリカ国債 0.375% 2016年1月15日	USD	2.0年	1.9%
10	ベルギー国債 3.5% 2017年6月28日	EUR	3.5年	1.8%

●債券現物のみ(先物を除く)の数値です。

年間収益率の推移



●本ファンドの収益率は、分配金(税引前)を再投資したものととして算出しています。

第3【ファンドの経理状況】

1 財務諸表

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」については、以下の内容が追加されます。

<追加>

(1) ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）及びゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。

なお、中間財務諸表に掲載している金額は、円単位で表示しております。

(2) A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）及びB 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期中間計算期間（2013年6月8日から2013年12月7日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

【ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第13期中間計算期間 (2013年12月7日現在)	
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	3,586,624,561
未収入金	401,146
流動資産合計	3,587,025,707
資産合計	3,587,025,707
負債の部	
流動負債	
未払解約金	401,146
未払受託者報酬	936,213
未払委託者報酬	16,851,859
その他未払費用	256,612
流動負債合計	18,445,830
負債合計	18,445,830
純資産の部	
元本等	
元本	2,818,066,675
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	750,513,202
（分配準備積立金）	319,619,187
元本等合計	3,568,579,877
純資産合計	3,568,579,877
負債純資産合計	3,587,025,707

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期中間計算期間 自 2013年 6 月 8 日 至 2013年12月 7 日
営業収益	
有価証券売買等損益	778,649
営業収益合計	778,649
営業費用	
受託者報酬	936,213
委託者報酬	16,851,859
その他費用	256,612
営業費用合計	18,044,684
営業利益又は営業損失()	18,823,333
経常利益又は経常損失()	18,823,333
中間純利益又は中間純損失()	18,823,333
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	2,654,969
期首剰余金又は期首欠損金()	768,386,797
剰余金増加額又は欠損金減少額	64,335,799
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	64,335,799
剰余金減少額又は欠損金増加額	66,041,030
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	66,041,030
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	750,513,202

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第13期中間計算期間 自 2013年6月8日 至 2013年12月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	第13期中間計算期間 (2013年12月7日現在)
1. 元本の推移	
期首元本額	2,817,598,339円
期中追加設定元本額	246,330,151円
期中一部解約元本額	245,861,815円
2. 受益権の総数	2,818,066,675口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	第13期中間計算期間 自 2013年6月8日 至 2013年12月7日
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	金融商品は時価で計上しているため記載を省略しております。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。 (2) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

区分	第13期中間計算期間 (2013年12月7日現在)
1口当たり純資産額	1.2663円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

【ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）】

（ 1 ）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第13期中間計算期間 (2013年12月7日現在)	
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	6,751,854,271
未収入金	8,266,849
流動資産合計	6,760,121,120
資産合計	6,760,121,120
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,266,849
未払受託者報酬	1,714,225
未払委託者報酬	30,856,020
その他未払費用	388,618
流動負債合計	41,225,712
負債合計	41,225,712
純資産の部	
元本等	
元本	4,195,249,971
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,523,645,437
（分配準備積立金）	913,710,101
元本等合計	6,718,895,408
純資産合計	6,718,895,408
負債純資産合計	6,760,121,120

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期中間計算期間 自 2013年 6 月 8 日 至 2013年12月 7 日
営業収益	
有価証券売買等損益	297,833,333
営業収益合計	297,833,333
営業費用	
受託者報酬	1,714,225
委託者報酬	30,856,020
その他費用	388,618
営業費用合計	32,958,863
営業利益又は営業損失 ()	264,874,470
経常利益又は経常損失 ()	264,874,470
中間純利益又は中間純損失 ()	264,874,470
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 ()	2,929,703
期首剰余金又は期首欠損金 ()	2,297,698,683
剰余金増加額又は欠損金減少額	137,171,819
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	137,171,819
剰余金減少額又は欠損金増加額	173,169,832
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	173,169,832
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金 ()	2,523,645,437

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第13期中間計算期間 自 2013年6月8日 至 2013年12月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価してあります。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	第13期中間計算期間 (2013年12月7日現在)
1. 元本の推移	
期首元本額	4,265,351,787円
期中追加設定元本額	254,030,739円
期中一部解約元本額	324,132,555円
2. 受益権の総数	4,195,249,971口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	第13期中間計算期間 自 2013年6月8日 至 2013年12月7日
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	金融商品は時価で計上しているため記載を省略しております。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。 (2) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

区分	第13期中間計算期間 (2013年12月7日現在)
1口当たり純資産額	1.6015円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

参考情報

A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）は、「ゴールドマン・サックス・世界債券オープンAコース（限定為替ヘッジ）マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	(2013年6月7日現在)	(2013年12月7日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		785,697,661	3,149,496
コール・ローン		604,093,584	2,533,920,677
国債証券		30,522,050,941	25,861,498,946
特殊債券		873,019,911	2,096,179,122
社債券		6,528,983,417	9,618,457,825
派生商品評価勘定		3,439,748,285	1,802,756,919
未収入金		1,529,435,055	729,768,977
未収利息		221,199,177	206,350,186
前払費用		61,678,348	69,634,447
差入委託証拠金		145,141,021	162,592,317
流動資産合計		44,711,047,400	43,084,308,912
資産合計		44,711,047,400	43,084,308,912
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,334,321,442	2,864,010,748
前受金		189,561	-
未払金		2,254,379,028	1,114,652,939
未払解約金		15,853,787	165,273,659
流動負債合計		4,604,743,818	4,143,937,346
負債合計		4,604,743,818	4,143,937,346
純資産の部			
元本等			
元本		27,801,157,975	27,001,373,957
剰余金			
剰余金又は欠損金()		12,305,145,607	11,938,997,609
元本等合計		40,106,303,582	38,940,371,566
純資産合計		40,106,303,582	38,940,371,566
負債純資産合計		44,711,047,400	43,084,308,912

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2012年6月8日 至 2013年6月7日	自 2013年6月8日 至 2013年12月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、法令及び一般社 団法人投資信託協会規則に従い、時 価評価しております。	国債証券、特殊債券、社債券 同左
2. デリバティブの評価基準及び 評価方法	(1) 為替予約取引 為替予約の評価は、原則とし て、わが国における対顧客先物売 買相場の仲値によって計算してお ります。 (2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び一般 社団法人投資信託協会規則に従 い、時価評価しております。 (3) オプション取引 個別法に基づき、原則として、 主たる取引所の発表する清算値段 又は最終相場で評価しておりま す。	(1) 為替予約取引 同左 (2) 先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための 基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信 託財産の計算に関する規則」(平成 12年総理府令第133号)第60条に基 づき、取引発生時の外国通貨の額を もって記録する方法を採用しており ます。 但し、同61条に基づき、外国通貨 の売却時において、当該外国通貨に 加えて、外貨建資産等の外貨基金勘 定及び外貨建各損益勘定の前日の外 貨建純資産額に対する当該売却外国 通貨の割合相当額を当該外国通貨の 売却時の外国為替相場等で円換算 し、前日の外貨基金勘定に対する円 換算した外貨基金勘定の割合相当の 邦貨建資産等の外国投資勘定と、円 換算した外貨基金勘定を相殺した差 額を為替差損益とする計理処理を採 用しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	(2013年6月7日現在)	(2013年12月7日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	22,327,777,513円	27,801,157,975円
期中追加設定元本額	10,903,167,309円	2,755,606,845円
期中一部解約元本額	5,429,786,847円	3,555,390,863円
期末元本額	27,801,157,975円	27,001,373,957円
元本の内訳		
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA 限定為替ヘッジ(確定拠出年金向け)	2,498,500,471円	2,486,912,052円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA 限定為替ヘッジ(野村SMA向け)	6,688,376,595円	5,573,560,897円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープン Cコース(毎月分配型、限定為替ヘッジ)	196,383,774円	200,284,768円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープン Aコース(限定為替ヘッジ)	2,216,972,518円	2,380,920,877円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA (限定為替ヘッジ)VA(適格機関投資家専用)	4,517,211,679円	3,994,735,994円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンF (適格機関投資家専用)	1,962,395,467円	2,170,370,221円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンFVA (適格機関投資家専用)	9,721,317,471円	10,194,589,148円
2. 受益権の総数	27,801,157,975口	27,001,373,957口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	自 2012年6月8日 至 2013年6月7日	自 2013年6月8日 至 2013年12月7日
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 2. 時価の算定方法	<p>金融商品は時価で計上しているため記載を省略しております。</p> <p>(1) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。なお、市場価格がない場合には、同種商品間の価格比較、同一銘柄の価格推移時系列比較、市場公表指標との整合分析等、定期的な状況確認を踏まえ、外部業者から入手する価格に基づく価額を合理的に算定された価額としております。</p> <p>(3) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」の「取引の時価等に関する事項」に記載しております。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2) 有価証券 同左</p> <p>(3) デリバティブ取引 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>同左</p>

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 債券関連

区分	種類	(2013年6月7日現在)				(2013年12月7日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引								
	買建	13,710,545,588	-	13,724,980,203	14,434,615	5,799,833,332	-	5,775,442,640	24,390,692
	売建	4,572,045,140	-	4,589,483,303	17,438,163	6,969,195,058	-	6,904,234,323	64,960,735
	合計	18,282,590,728	-	18,314,463,506	3,003,548	12,769,028,390	-	12,679,676,963	40,570,043

(2) 通貨関連

区分	種類	(2013年6月7日現在)				(2013年12月7日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引								
	買建								
	米ドル	36,580,784,779	-	36,314,240,043	266,544,736	26,976,346,227	-	27,623,808,241	647,462,014
	カナダドル	3,688,507,260	-	3,646,149,592	42,357,668	1,553,906,480	-	1,554,297,375	390,895
	ユーロ	17,560,058,922	-	17,706,228,984	146,170,062	12,507,067,610	-	13,038,657,951	531,590,341
	英ポンド	5,514,656,833	-	5,604,204,864	89,548,031	8,718,258,666	-	8,976,061,274	257,802,608
	スイスフラン	6,184,017,985	-	6,203,470,137	19,452,152	1,027,719,480	-	1,068,535,116	40,815,636
	スウェーデン クローナ	2,268,204,342	-	2,251,757,936	16,446,406	1,672,890,840	-	1,717,382,080	44,491,240
	ノルウェー クローネ	1,372,148,600	-	1,406,651,363	34,502,763	2,190,902,006	-	2,214,577,540	23,675,534
	オーストラリ アドル	6,779,213,915	-	6,371,728,513	407,485,402	3,501,255,801	-	3,480,234,693	21,021,108
	ニュージーラ ンドドル	2,724,281,860	-	2,612,152,164	112,129,696	1,854,221,119	-	1,889,001,230	34,780,111
	売建								
	米ドル	48,545,538,093	-	47,609,131,013	936,407,080	32,022,958,865	-	33,039,517,732	1,016,558,867
	カナダドル	4,632,709,186	-	4,565,507,236	67,201,950	3,747,304,902	-	3,748,492,935	1,188,033
	ユーロ	28,350,654,245	-	28,291,329,567	59,324,678	25,733,661,352	-	26,770,372,013	1,036,710,661
	英ポンド	8,827,286,587	-	8,852,330,664	25,044,077	11,470,755,136	-	11,851,761,220	381,006,084
	スイスフラン	7,337,519,226	-	7,419,513,340	81,994,114	3,009,027,108	-	3,172,139,976	163,112,868
	スウェーデン クローナ	3,413,533,019	-	3,346,682,778	66,850,241	2,055,677,096	-	2,104,739,983	49,062,887
	ノルウェー クローネ	1,409,413,782	-	1,406,651,363	2,762,419	1,273,838,528	-	1,271,468,439	2,370,089
	デンマーク クローネ	284,300,652	-	277,049,326	7,251,326	297,355,601	-	299,149,215	1,793,614
オーストラリ アドル	7,444,837,143	-	6,966,096,869	478,740,274	3,318,957,243	-	3,286,873,614	32,083,629	
ニュージーラ ンドドル	2,774,582,032	-	2,619,117,677	155,464,355	2,497,771,688	-	2,545,119,329	47,347,641	
	合計	195,692,248,461	-	193,469,993,429	1,111,673,232	145,429,875,748	-	149,652,189,956	1,102,339,666

(3) 金利関連

区分	種類	(2013年6月7日現在)				(2013年12月7日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	金利先物取引								
	買建	4,620,887,250	4,620,887,250	4,617,644,409	3,242,841	3,496,030,252	3,496,030,252	3,503,196,840	7,166,588
	売建	-	-	-	-	3,841,897,074	3,138,539,028	3,848,547,868	6,650,794
	合計	4,620,887,250	4,620,887,250	4,617,644,409	3,242,841	7,337,927,326	6,634,569,280	7,351,744,708	515,794

(注) 時価の算定方法

・先物取引

- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引について、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

・為替予約取引

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - 予約為替の受渡し日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。
 - 当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客相場の仲値により評価しております。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

項目	(2013年6月7日現在)	(2013年12月7日現在)
1口当たり純資産額	1.4426円	1.4422円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

B 為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)は、「ゴールドマン・サックス・世界債券オープンBコース(為替ヘッジなし)マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	(2013年6月7日現在)	(2013年12月7日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		-	2,921,548
コール・ローン		2,735,161,644	4,611,968,286
国債証券		67,245,492,662	61,887,921,956
特殊債券		3,696,100,764	6,949,434,470
社債券		19,821,118,570	24,603,654,388
派生商品評価勘定		6,965,369,530	4,860,095,091
未収入金		4,435,695,191	2,405,565,037
未収利息		633,508,541	498,940,714
前払費用		58,261,626	136,408,043
差入委託証拠金		513,564,840	357,468,414
流動資産合計		106,104,273,368	106,314,377,947
資産合計		106,104,273,368	106,314,377,947
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,863,321,031	4,907,735,427
前受金		680,427	-
未払金		3,644,888,872	3,491,397,760
未払解約金		23,577,476	85,936,985
流動負債合計		10,532,467,806	8,485,070,172
負債合計		10,532,467,806	8,485,070,172
純資産の部			
元本等			
元本		51,831,129,249	50,739,706,261
剰余金			
剰余金又は欠損金()		43,740,676,313	47,089,601,514
元本等合計		95,571,805,562	97,829,307,775
純資産合計		95,571,805,562	97,829,307,775
負債純資産合計		106,104,273,368	106,314,377,947

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2012年6月8日 至 2013年6月7日	自 2013年6月8日 至 2013年12月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、法令及び一般社 団法人投資信託協会規則に従い、時 価評価しております。	国債証券、特殊債券、社債券 同左
2. デリバティブの評価基準及び 評価方法	(1) 為替予約取引 為替予約の評価は、原則とし て、わが国における対顧客先物売 買相場の仲値によって計算してお ります。 (2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び一般 社団法人投資信託協会規則に従 い、時価評価しております。 (3) オプション取引 個別法に基づき、原則として、 主たる取引所の発表する清算値段 又は最終相場で評価しております。	(1) 為替予約取引 同左 (2) 先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための 基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信 託財産の計算に関する規則」(平成 12年総理府令第133号)第60条に基 づき、取引発生時の外国通貨の額を もって記録する方法を採用してお ります。 但し、同61条に基づき、外国通貨 の売却時において、当該外国通貨に 加えて、外貨建資産等の外貨基金勘 定及び外貨建各損益勘定の前日の外 貨建純資産額に対する当該売却外国 通貨の割合相当額を当該外国通貨の 売却時の外国為替相場等で円換算 し、前日の外貨基金勘定に対する円 換算した外貨基金勘定の割合相当の 邦貨建資産等の外国投資勘定と、円 換算した外貨基金勘定を相殺した差 額を為替差損益とする計理処理を採 用しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	(2013年6月7日現在)	(2013年12月7日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	55,461,331,833円	51,831,129,249円
期中追加設定元本額	5,769,012,420円	3,383,275,844円
期中一部解約元本額	9,399,215,004円	4,474,698,832円
期末元本額	51,831,129,249円	50,739,706,261円
元本の内訳		
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB 為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)	3,576,973,535円	3,501,817,474円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB 為替ヘッジなし(野村SMA向け)	3,689,008,374円	4,737,718,216円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープン Dコース(毎月分配型、為替ヘッジなし)	275,303,558円	260,434,261円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープン Bコース(為替ヘッジなし)	2,451,401,099円	2,349,739,186円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB (為替ヘッジなし)VA(適格機関投資家専用)	41,838,442,683円	39,889,997,124円
2. 受益権の総数	51,831,129,249口	50,739,706,261口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	自 2012年6月8日 至 2013年6月7日	自 2013年6月8日 至 2013年12月7日
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 2. 時価の算定方法	<p>金融商品は時価で計上しているため記載を省略しております。</p> <p>(1) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。なお、市場価格がない場合には、同種商品間の価格比較、同一銘柄の価格推移時系列比較、市場公表指標との整合分析等、定期的な状況確認を踏まえ、外部業者から入手する価格に基づく価額を合理的に算定された価額としております。</p> <p>(3) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」の「取引の時価等に関する事項」に記載しております。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2) 有価証券 同左</p> <p>(3) デリバティブ取引 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>同左</p>

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 債券関連

区分	種類	(2013年6月7日現在)				(2013年12月7日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引								
	買建	39,799,799,475	-	39,838,379,329	38,579,854	21,630,712,367	-	21,527,472,216	103,240,151
	売建	18,424,761,957	-	18,471,208,436	46,446,479	17,957,381,397	-	17,790,348,361	167,033,036
	合計	58,224,561,432	-	58,309,587,765	7,866,625	39,588,093,764	-	39,317,820,577	63,792,885

(2) 通貨関連

区分	種類	(2013年6月7日現在)				(2013年12月7日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引								
	買建								
	米ドル	110,088,781,014	-	108,951,480,501	1,137,300,513	75,099,405,219	-	77,033,925,916	1,934,520,697
	カナダドル	10,543,277,860	-	10,416,107,059	127,170,801	3,896,858,420	-	3,897,711,788	853,368
	ユーロ	47,595,365,036	-	48,041,044,127	445,679,091	33,119,684,108	-	34,478,468,664	1,358,784,556
	英ポンド	15,167,241,624	-	15,426,694,753	259,453,129	14,015,515,454	-	14,715,944,076	700,428,622
	スイスフラン	16,752,455,520	-	16,807,619,317	55,163,797	2,617,449,077	-	2,725,376,164	107,927,087
	スウェーデン クローナ	6,155,598,184	-	6,109,761,248	45,836,936	4,370,271,728	-	4,493,299,287	123,027,559
	ノルウェー クローネ	3,955,725,585	-	4,046,854,187	91,128,602	5,519,211,133	-	5,578,971,016	59,759,883
	デンマーク クローネ	-	-	-	-	99,997,964	-	100,601,140	603,176
	オーストラリ アドル	18,361,503,041	-	17,217,077,530	1,144,425,511	9,079,661,554	-	9,020,659,608	59,001,946
	ニュージーラ ンドドル	7,434,055,340	-	7,124,619,005	309,436,335	4,559,638,465	-	4,646,969,131	87,330,666
	売建								
	米ドル	98,113,763,460	-	97,252,198,728	861,564,732	52,503,412,253	-	54,092,574,753	1,589,162,500
	カナダドル	11,881,850,823	-	11,708,256,633	173,594,190	7,984,163,000	-	8,000,076,441	15,913,441
	ユーロ	51,369,890,233	-	51,838,991,312	469,101,079	42,336,556,075	-	43,987,822,601	1,651,266,526
	英ポンド	15,926,552,027	-	16,106,029,780	179,477,753	12,963,828,305	-	13,568,612,308	604,784,003
	スイスフラン	19,618,513,014	-	19,857,246,494	238,733,480	7,637,907,103	-	8,052,805,221	414,898,118
	スウェーデン クローナ	8,679,930,380	-	8,513,394,108	166,536,272	4,895,075,557	-	5,004,850,776	109,775,219
	ノルウェー クローネ	4,057,059,025	-	4,046,854,188	10,204,837	3,198,127,436	-	3,192,067,652	6,059,784
	デンマーク クローネ	426,777,312	-	415,892,000	10,885,312	-	-	-	-
	オーストラリ アドル	19,223,620,818	-	17,955,661,523	1,267,959,295	8,123,127,338	-	8,045,871,954	77,255,384
	ニュージーラ ンドドル	7,515,971,346	-	7,088,905,131	427,066,215	6,254,995,110	-	6,373,852,826	118,857,716
	合計	472,867,931,642	-	468,924,687,624	117,753,064	298,274,885,299	-	307,010,461,322	107,108,687

(3) 金利関連

区分	種類	(2013年6月7日現在)				(2013年12月7日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	金利先物取引								
	買建	11,167,145,260	11,167,145,260	11,159,307,320	7,837,940	6,195,957,794	6,195,957,794	6,208,655,232	12,697,438
	売建	-	-	-	-	9,161,494,492	7,998,007,570	9,178,516,464	17,021,972
合計		11,167,145,260	11,167,145,260	11,159,307,320	7,837,940	15,357,452,286	14,193,965,364	15,387,171,696	4,324,534

(注) 時価の算定方法

・先物取引

- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引について、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

・為替予約取引

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - 予約為替の受渡し日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。
 - 当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客相場の仲値により評価しております。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

区分	(2013年6月7日現在)	(2013年12月7日現在)
1口当たり純資産額	1.8439円	1.9281円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

2 ファンドの現況

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」については、以下の内容に更新されます。

<訂正・更新後>

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）>

純資産額計算書

（2013年12月30日現在）

資産総額	3,575,478,312円
負債総額	2,085,668円
純資産総額（ - ）	3,573,392,644円
発行済口数	2,818,424,802口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2679円

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

純資産額計算書

（2013年12月30日現在）

資産総額	6,914,064,509円
負債総額	3,974,222円
純資産総額（ - ）	6,910,090,287円
発行済口数	4,192,184,360口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6483円

参考情報

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A コース（限定為替ヘッジ）マザーファンド>

純資産額計算書

（2013年12月30日現在）

資産総額	36,636,359,816円
負債総額	1,058,408,591円
純資産総額（ - ）	35,577,951,225円
発行済口数	24,623,574,006口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4449円

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B コース（為替ヘッジなし）マザーファンド>

純資産額計算書

（2013年12月30日現在）

資産総額	100,412,177,296円
負債総額	1,107,268,320円
純資産総額（ - ）	99,304,908,976円
発行済口数	50,013,584,769口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9856円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」については、下記の内容に更新されます。

<訂正・更新後>

事業の内容

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその投資運用業務および投資助言業務を行っています。また、金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業務および第二種金融商品取引業務を行っています。

委託会社の運用するファンド

2014年1月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（親投資信託を除きます。）。

種類	本数	純資産総額（円）
追加型株式投資信託	100	1,457,519,127,990
合計	100	1,457,519,127,990

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」については、下記の内容に更新されます。

<訂正・更新後>

1. 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人の中間監査を受けております。

(1) 貸借対照表

期別		第17期 (平成24年3月31日現在)			第18期 (平成25年3月31日現在)		
資産の部							
科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
流動資産							
現金・預金			3,285,446			3,799,436	
有価証券			11,797,976			10,197,717	
支払委託金			25			51	
収益分配金		25			51		
前払費用			468			-	
未収入金	* 1		406,284			-	
未収委託者報酬			1,064,467			1,349,584	
未収運用受託報酬			1,026,201			1,052,020	
未収収益			159,925			250,263	
立替金			34,566			58,689	
繰延税金資産			489,782			655,118	
流動資産計			18,265,146	90.9		17,362,882	78.5
固定資産							
無形固定資産			694			-	
その他の無形固定資産		694			-		
投資その他の資産			1,830,583			4,744,062	
投資有価証券		684,540			3,515,336		
長期差入保証金		10,000			10,000		
繰延税金資産		1,135,876			1,218,726		
その他の投資等		166			-		
固定資産計			1,831,278	9.1		4,744,062	21.5
資産合計			20,096,424	100.0		22,106,945	100.0

期別		第17期 (平成24年3月31日現在)			第18期 (平成25年3月31日現在)		
負債の部							
科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
流動負債							
預り金			82			296	
未払金			853,668			533,934	
未払収益分配金		151			177		
未払償還金		72			72		
未払手数料		447,157			533,685		
その他未払金		406,287			-		
未払費用			1,998,271			2,373,586	
未払法人税等			190,726			678,381	
未払消費税等			30,533			99,850	
流動負債計			3,073,282	15.3		3,686,048	16.7
固定負債							
長期未払費用			2,945,495			3,835,760	
役員退職慰労引当金			222,911			222,911	
その他固定負債			650			650	
固定負債計			3,169,057	15.8		4,059,322	18.4
負債合計			6,242,339	31.1		7,745,371	35.0

期別		第17期 (平成24年3月31日現在)			第18期 (平成25年3月31日現在)		
純資産の部							
科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
株主資本							
資本金			490,000			490,000	
資本剰余金			390,000			390,000	
資本準備金		390,000			390,000		
利益剰余金			12,921,678			13,224,106	
その他利益剰余金		12,921,678			13,224,106		
繰越利益剰余金		12,921,678			13,224,106		
株主資本合計			13,801,678	68.7		14,104,106	63.8
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金		52,406			257,467		
評価・換算差額等合計			52,406	0.3		257,467	1.2
純資産合計			13,854,085	68.9		14,361,574	65.0
負債・純資産合計			20,096,424	100.0		22,106,945	100.0

(2) 損益計算書

期別		第17期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日			第18期 自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日				
		科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
経常 損益の 部	営業 損益の 部	営業収益		千円	千円	%	千円	千円	%
		委託者報酬			9,262,739			10,394,695	
		運用受託報酬			5,636,349			5,903,536	
		その他営業収益	* 2		5,514,145			5,346,245	
		営業収益計			20,413,234	100.0		21,644,477	100.0
		営業費用							
		支払手数料			4,702,587			4,828,407	
		広告宣伝費			165,456			356,368	
		調査費			4,318,795			4,843,198	
		委託調査費	* 2	4,318,795				4,843,198	
		委託計算費			163,984			187,048	
		営業雑経費			365,639			412,224	
		通信費		212,981				254,451	
		印刷費		130,935				128,462	
		協会費		21,722				29,310	
		営業費用計			9,716,463	47.6		10,627,248	49.1
		一般管理費							
		給料			5,308,793			6,758,363	
		役員報酬		163,438				178,109	
		給料・手当		2,866,902				2,621,391	
		賞与		488,900				1,291,499	
		株式従業員報酬	* 1	199,573				807,717	
		その他の報酬		1,589,978				1,859,646	
		交際費			26,547			38,921	
		寄付金			92,237			19,338	
		旅費交通費			204,386			167,344	
		租税公課			60,314			49,118	
		不動産賃借料			458,251			482,119	
		退職給付費用			635,720			843,772	
		固定資産減価償却費			24,336			-	
事務委託費			386,181			457,831			
諸経費			1,284,675			1,084,126			
一般管理費計			8,481,445	41.5		9,900,937	45.7		
営業利益			2,215,325	10.9		1,116,291	5.2		

期別		第17期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日			第18期 自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日			
		科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額
経常損益の部	営業外収益							
	収益分配金				-		68,834	
	受取利息				21,224		16,255	
	投資有価証券売却益				77,795		-	
	株式従業員報酬	* 1,2			251,012		-	
	為替差益				-		14,373	
	雑益				2,903		52	
	営業外収益計				352,935	1.7	99,515	0.5
	営業外費用							
	支払利息				0		26	
	株式従業員報酬	* 1			-		257,196	
	為替差損				22,648		-	
	雑損				0		-	
	営業外費用計				22,649	0.1	257,223	1.2
経常利益					2,545,612	12.5	958,583	4.4

期別		第17期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日			第18期 自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日			
科目		注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
特別 損益 の部	特別利益							
	金融商品取引責任準備 金戻入額			0			-	
	特別利益計			0	0.0		-	0.0
	特別損失							
	特別損失計			-	0.0		-	0.0
税引前当期純利益				2,545,613	12.5		958,583	4.4
法人税、住民税及び事業税				731,215	3.6		1,030,076	4.8
法人税等調整額				452,629	2.2		373,921	1.7
当期純利益				1,361,767	6.7		302,428	1.4

(3) 株主資本等変動計算書

第17期
(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
平成23年4月1日残高	490,000	390,000	390,000	14,559,911	14,559,911	15,439,911	47,111	47,111	15,487,022
事業年度中の変動額									
剰余金の配当				3,000,000	3,000,000	3,000,000			3,000,000
当期純利益				1,361,767	1,361,767	1,361,767			1,361,767
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							5,294	5,294	5,294
事業年度中の変動額合計	-	-	-	1,638,232	1,638,232	1,638,232	5,294	5,294	1,632,937
平成24年3月31日残高	490,000	390,000	390,000	12,921,678	12,921,678	13,801,678	52,406	52,406	13,854,085

第18期
(自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
平成24年4月1日残高	490,000	390,000	390,000	12,921,678	12,921,678	13,801,678	52,406	52,406	13,854,085
事業年度中の変動額									
当期純利益				302,428	302,428	302,428			302,428
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							205,061	205,061	205,061
事業年度中の変動額合計	-	-	-	302,428	302,428	302,428	205,061	205,061	507,489
平成25年3月31日残高	490,000	390,000	390,000	13,224,106	13,224,106	14,104,106	257,467	257,467	14,361,574

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のあるもの</p> <p>時価をもって貸借対照表価額とし、取得原価（移動平均法による原価法）ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入する方法によっております。</p> <p>時価のないもの</p> <p>移動平均法による原価法によっております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 役員退職慰労引当金</p> <p>役員退職慰労金の支出に備えて、当社内規に基づく期末要支給見積額を計上しております。</p> <p>(2) 貸倒引当金</p> <p>貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(3) 金融商品取引責任準備金</p> <p>金融商品取引事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の5第1項に基づく責任準備金を計上しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法</p> <p>役員及び従業員に付与されております、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬については、企業会計基準第8号「ストック・オプション等に関する会計基準」及び企業会計基準適用指針第11号「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」に準じて、権利付与日公正価値及び付与された株数に基づき計算される費用を権利確定計算期間にわたり人件費（営業費用及び一般管理費）として処理しております。また、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクおよびゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限公司との契約に基づき当社が負担する、権利付与日以降の株価の変動により発生する損益については営業外損益として処理しております。</p> <p>(2) 消費税等の会計処理</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

第17期 (平成24年3月31日現在)	第18期 (平成25年3月31日現在)
* 1 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には次のものがあります。 流動資産 未収入金 404,033千円	* 1 関係会社項目 該当事項はありません。

(損益計算書関係)

第17期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第18期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
* 1 株式従業員報酬 役員及び従業員に付与されておりますザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬に関するものであり、当該株式の株価及び付与された株数に基づき算出し配賦されております。 * 2 関係会社項目 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 営業収益 その他営業収益 5,452,985千円 営業費用 委託調査費 4,318,795千円 営業外収益 株式従業員報酬 56,181千円	* 1 株式従業員報酬 同左 * 2 関係会社項目 同左 営業収益 その他営業収益 5,294,986千円 営業費用 委託調査費 4,843,198千円

（株主資本等変動計算書関係）

第17期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,400	-	-	6,400

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり配当 額（円）	基準日	効力発生日
平成24年3月12日 臨時株主総会	普通株式	3,000,000	468,750	平成24年3月22日	平成24年3月22日

第18期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,400	-	-	6,400

2．配当に関する事項

該当事項はありません。

（リース取引関係）

第17期 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	第18期 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
注記すべきリース取引を行っていないため、該当事項はありません。	同左

（金融商品に関する注記）

第17期

（自 平成23年4月1日
至 平成24年3月31日）

(1) 金融商品の状況に関する事項

金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業、投資助言・代理業を含む金融商品取引法により金融商品取引業者が行うことができる業務、及びこれに付帯関連する業務を行っております。これらの業務に関連し、当社は、主に現金・預金、コマーシャル・ペーパー、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬といった金融資産を保有しております。なお、当社は、資金運用については短期的な預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定する方針です。

金融商品に係るリスク及びその管理体制

金融商品に係るリスクは、信用リスク、市場リスク、流動性リスク等であります。当社は、効率的なリスク管理が極めて重要であると考えており、職務の分掌と経営陣による監督は、当社リスク管理手続の重要な要素であります。

信用リスク

信用リスクとしては主に、当社が保有する預金に係る銀行の信用リスク、保有するコマーシャル・ペーパーに係る発行体の信用リスク、当社が運用する投資信託から受領する委託者報酬及び投資一任契約に基づき顧客から受領する運用受託報酬に関して、運用資産が悪化した場合に未収委託者報酬及び未収運用受託報酬を回収できず、当社が損失を被るリスクがあります。

当社は、預金に係る銀行の信用リスクに関しては、口座開設時、およびその後継続的に銀行の信用力を評価し、また各銀行に預け入れる金額に上限を設けることにより、預金に係る信用リスクを管理しております。

コマーシャル・ペーパーに関しましては、主にゴールドマン・サックスのグループ会社が発行するものとし、定期的に見直すことによって信用リスクを管理しております。

また、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬に関しては、過去に回収できなかったケースは無く、特に未収委託者報酬に関しては、受託者たる信託銀行で分別管理されている当社が運用する信託財産から受領するため、リスクは非常に低いものと考えております。

市場リスク

当社は、海外の関連会社との取引により生じた外国通貨建て資産負債を保有していることから、為替相場の変動によるリスクに晒されております。当社は為替リスクを管理するため、外貨建資産負債の純額が予め社内設定した水準を越える場合、当該通貨の売買を行い、為替リスクを削減しております。

流動性および資金調達リスク

当社は総資産の75%以上が現金・預金及びコマーシャル・ペーパーであり、また現金・預金及びコマーシャル・ペーパーの残高は負債総額を超えており、当社において流動性リスク及び資金調達リスクは非常に低いものと考えております。また、当社は、資金運用を預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定することで流動性リスクを管理しており、親会社との間で劣後条件付リボルビング・クレジット・ローン契約を締結することで、必要な場合の資金調達手段を確保し、資金調達リスクに備えております。

第17期
(自 平成23年4月1日
至 平成24年3月31日)

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日現在における貸借対照表計上額、貸借対照表日における時価及びその差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	3,285,446	3,285,446	-
有価証券			
その他有価証券	11,797,976	11,797,976	-
未収委託者報酬	1,064,467	1,064,467	-
未収運用受託報酬	1,026,201	1,026,201	-

金融商品の時価の算定方法

上記金融資産については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

金銭債権及び満期のある有価証券の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
現金・預金	3,285,446	-	-	-	-	-
有価証券						
その他有価証券の うち満期があるもの	11,800,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,064,467	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,026,201	-	-	-	-	-

第18期
（自 平成24年4月1日
至 平成25年3月31日）

(1) 金融商品の状況に関する事項

金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業、投資助言・代理業を含む金融商品取引法により金融商品取引業者が行うことができる業務、及びこれに付帯関連する業務を行っております。これらの業務に関連し、当社は、主に現金・預金、コマーシャル・ペーパー、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び投資有価証券といった金融資産を保有しております。なお、当社は、資金運用については短期的な預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定する方針です。投資有価証券は事業推進目的のために保有する当社設定の投資信託であります。

金融商品に係るリスク及びその管理体制

金融商品に係るリスクは、信用リスク、市場リスク、流動性リスク等であります。当社は、効率的なリスク管理が極めて重要であると考えており、職務の分掌と経営陣による監督は、当社リスク管理手続の重要な要素であります。

信用リスク

信用リスクとしては主に、当社が保有する預金に係る銀行の信用リスク、保有するコマーシャル・ペーパーに係る発行体の信用リスク、当社が運用する投資信託から受領する委託者報酬及び投資一任契約に基づき顧客から受領する運用受託報酬に関して、運用資産が悪化した場合に未収委託者報酬及び未収運用受託報酬を回収できず、当社が損失を被るリスクがあります。

当社は、預金に係る銀行の信用リスクに関しては、口座開設時、およびその後継続的に銀行の信用力を評価し、また各銀行に預け入れる金額に上限を設けることにより、預金に係る信用リスクを管理しております。コマーシャル・ペーパーに関しましては、主にゴールドマン・サックスのグループ会社が発行するものとし、定期的に見直すことによって信用リスクを管理しております。

また、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬に関しては、過去に回収できなかったケースは無く、特に未収委託者報酬に関しては、受託者たる信託銀行で分別管理されている当社が運用する信託財産から受領するため、リスクは非常に低いものと考えております。

市場リスク

当社は、海外の関連会社との取引により生じた外国通貨建て資産負債を保有していることから、為替相場の変動によるリスクに晒されております。当社は為替リスクを管理するため、外貨建資産負債の純額が予め社内で設定した水準を越える場合、当該通貨の売買を行い、為替リスクを削減しております。また、当社は事業推進目的のために当社設定の投資有価証券を保有していることから、基準価額の変動による価格変動リスクに晒されております。係る投資有価証券については運用を行う資産の種類を文書に定め、取得にあたり事前に社内委員会にて検討・承認をし、保有の目的が達成されたと判断された時点で適時処分しております。

流動性および資金調達リスク

当社は総資産の60%以上が現金・預金及びコマーシャル・ペーパーであり、また現金・預金及びコマーシャル・ペーパーの残高は負債総額を超えており、当社において流動性リスク及び資金調達リスクは非常に低いものと考えております。また、当社は、資金運用を預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定することで流動性リスクを管理しており、親会社との間で劣後条件付リボルビング・クレジット・ローン契約を締結することで、必要な場合の資金調達手段を確保し、資金調達リスクに備えております。

第18期
(自 平成24年4月1日
至 平成25年3月31日)

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成25年3月31日現在における貸借対照表計上額、貸借対照表日における時価及びその差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	3,799,436	3,799,436	-
有価証券			
その他有価証券	10,197,717	10,197,717	-
未収委託者報酬	1,349,584	1,349,584	-
未収運用受託報酬	1,052,020	1,052,020	-
投資有価証券			
その他投資有価証券	3,515,336	3,515,336	-

金融商品の時価の算定方法

現金・預金、有価証券、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。投資有価証券については、投資信託であり、直近の基準価額によっております。

金銭債権及び満期のある有価証券の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
現金・預金	3,799,436	-	-	-	-	-
有価証券						
その他有価証券の うち満期があるもの	10,200,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,349,584	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,052,020	-	-	-	-	-

（有価証券関係）

第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）					第18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）				
1. その他有価証券で時価のあるもの					1. その他有価証券で時価のあるもの				
区分	種類	取得原価 （千円）	貸借対照 表計上額 （千円）	差額 （千円）	区分	種類	取得原価 （千円）	貸借対照 表計上額 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託受益証券	600,000	684,540	84,540	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,100,000	3,515,336	415,336
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	コマーシャル・ペーパー	11,797,976	11,797,976	-	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	コマーシャル・ペーパー	10,197,717	10,197,717	-
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券					2. 当事業年度中に売却したその他有価証券				
売却額（千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）			売却額（千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）		
1,095,821	77,795	-			1,900,000	-	-		

（デリバティブ取引関係）

第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）	第18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）
当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。	同左

（退職給付関係）

第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）	第18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）
1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職給付制度を採用しておりません。	1. 採用している退職給付制度の概要 同左
2. 退職給付費用に関する事項 損益計算書上、出向者負担金等に含まれる退職給付費用負担金相当額を、退職給付費用として計上しております。	2. 退職給付費用に関する事項 同左

（税効果会計関係）

第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）	第18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳
繰延税金資産（流動資産）	繰延税金資産（流動資産）
未払費用 456,569千円	未払費用 592,366千円
未払事業税 15,881	未払事業税 54,579
その他 17,331	その他 8,172
小計 489,782	小計 655,118
繰延税金負債（流動負債）	繰延税金負債（流動負債）
小計 -	小計 -
繰延税金資産（流動資産）の純額 489,782	繰延税金資産（流動資産）の純額 655,118
繰延税金資産（固定資産）	繰延税金資産（固定資産）
長期未払費用 1,033,933	長期未払費用 1,239,518
役員退職慰労引当金 81,558	役員退職慰労引当金 80,193
その他 52,518	その他 56,884
小計 1,168,010	小計 1,376,595
繰延税金負債（固定負債）	繰延税金負債（固定負債）
その他有価証券評価差額金 32,133	その他有価証券評価差額金 157,869
小計 32,133	小計 157,869
繰延税金資産（固定資産）の純額 1,135,876千円	繰延税金資産（固定資産）の純額 1,218,726千円
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率 40.69 %	法定実効税率 38.01 %
（調整）	（調整）
法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正 6.24 %	賞与等永久に損金に算入されない項目 26.89 %
その他 - 0.42 %	その他 3.55 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率 46.51 %	税効果会計適用後の法人税等の負担率 68.45 %

<p style="text-align: center;">第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）</p>	<p style="text-align: center;">第18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）</p>
<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、従来の40.69%から、平成24年4月1日に開始する事業年度以降、平成27年3月31日までに終了する事業年度までに解消が見込まれる一時差異については38.01%、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.64%となります。この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は156,460千円減少し、その他有価証券評価差額金が2,268千円、法人税等調整額が158,728千円それぞれ増加しております。</p> <p>4. 決算日後に法人税等の税率の変更があった場合のその内容及び影響</p> <p>該当事項はありません。</p>	<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>4. 決算日後に法人税等の税率の変更があった場合のその内容及び影響</p> <p>該当事項はありません。</p>

〔セグメント情報等〕

第17期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

〔セグメント情報〕

当社の報告セグメントは、投資運用業者として単一であるため、該当事項はありません。

〔関連情報〕

1．製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ファンド 関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	9,262,739	5,636,349	5,514,145	20,413,234

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
18,556,174	1,857,060	20,413,234

海外の外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める地域はありません。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、該当事項はありません。

第18期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

〔セグメント情報〕

当社の報告セグメントは、投資運用業者として単一であるため、該当事項はありません。

〔関連情報〕

1．製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ファンド 関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	10,394,695	5,903,536	5,346,245	21,644,477

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
19,592,948	2,051,528	21,644,477

海外の外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める地域はありません。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

第17期
（自 平成23年4月1日
至 平成24年3月31日）

親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有（被所 有）割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
親会社	ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	アメリカ合衆国 ニュー ヨーク州	3,108 百万ドル	持株会社	被所有 直接 1% 間接 99%	株式従業員報酬の配賦	株式従業員報酬（注1）	56,181		
親会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー	アメリカ合衆国 ニュー ヨーク州	316 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	その他営業収益（注2） 委託調査費の支払（注2）	5,452,985 4,318,795	未収入金	393,727

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）持株会社の株価及び付与された株数に基づき、算出し配賦されております。

（注2）その他営業収益及び委託調査費の支払に関しては、関係会社間の契約に基づき決定しております。

役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

第17期
（自 平成23年4月1日
至 平成24年3月31日）

兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有（被所 有）割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
親会社 の子会 社	ゴールドマン・サックス証券株式会社	東京都港区	83,616 百万円	金融商品取引業		業務委託 役員の兼 任 有価証券 の購入	兼務従業員の 人件費等の支 払（注1）	2,304,783	有価証券	11,797,976
親会社 の子会 社	ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス 株式会社	東京都港区	100 百万円	ゴールドマン・サックス・グループ人事・総務・施設管理業務受託		従業員出 向受入等 役員の兼 任	出向者に関する 人件費等の 負担金 （注2） 営業費用及 び一般管理 費 株式従業員 報酬	5,339,280 171,617	未払費用 長期未払 費用	1,111,143 3,017,713
親会社 の子会 社	ゴールドマン・サックス・バンク・USA	アメリカ合衆国 ユタ州	19,214 百万ドル	銀行業		現金の預 入			現金・預 金	360,145
親会社 の子会 社	ゴールドマン・サックス・インベストメント・ストラテジー・LLC	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	32 百万ドル	投資顧問業		投資助言			未払費用	212,193

取引条件及び取引条件の決定方針等

- （注1）兼務従業員の人件費等の支払に関しては、グループ会社間の契約に基づき、決定しております。
- （注2）ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス株式会社（以下G S J H）より出向している役員及び従業員の給料、賞与、退職金等の支払はG S J Hより行われております。
- 但し、これらの費用はG S J Hより当社に請求されるものであり、賞与及び退職給付の引当額については、当社においてはG S J Hに対する債務として処理しております。

親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

- ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク（ニューヨーク証券取引所に上場）
ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー（未上場）

第18期
（自 平成24年4月1日
至 平成25年3月31日）

親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有（被所 有）割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
親会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	293 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	その他営業収益（注1） 委託調査費の支払（注1）	5,294,986 4,843,198		

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）その他営業収益及び委託調査費の支払に関しては、関係会社間の契約に基づき決定しております。

役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有（被所 有）割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス証券株式会社	東京都港区	83,616 百万円	金融商品取引業		業務委託 役員の兼任 有価証券 の購入	兼務従業員の 人件費等の支 払（注1）	2,408,126	有価証券 未払費用	10,197,717 309,903
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス 有限公司	東京都港区	100 百万円	ゴールドマン・サックス・グループ人事・総務・施設管理業務受託		従業員出 向受入等 役員の兼任	出向者に関する 人件費等の 負担金 （注2） 営業費用及 び一般管理 費 株式従業員 報酬	6,694,581 230,495	未払費用 長期未払 費用	1,335,190 3,706,199
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・バンク・USA	アメリカ合衆国 ユタ州	20,667 百万ドル	銀行業		現金の預 入			現金・預 金	579,001

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）兼務従業員の人件費等の支払に関しては、グループ会社間の契約に基づき、決定しております。

（注2）ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限公司（以下GSJH）より出向している役員及び従業員の給料、賞与、退職金等の支払はGSJHより行われております。
但し、これらの費用はGSJHより当社に請求されるものであり、賞与及び退職給付の引当額については、当社においてはGSJHに対する債務として処理しております。

親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク（ニューヨーク証券取引所に上場）

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー（未上場）

（1株当たり情報）

第17期 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）		第18期 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）	
1株当たり純資産額	2,164,700円82銭	1株当たり純資産額	2,243,995円98銭
1株当たり当期純利益金額	212,776円18銭	1株当たり当期純利益金額	47,254円38銭
損益計算書上の当期純利益	1,361,767千円	損益計算書上の当期純利益	302,428千円
1株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益	1,361,767千円	1株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益	302,428千円
差額	-	差額	-
期中平均株式数		期中平均株式数	
普通株式	6,400株	普通株式	6,400株
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株予約権付社債等潜在株式がないため記載しておりません。		同左	

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

1. 中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

区分	注記 番号	第19期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
		金額	構成比
(資産の部)		千円	%
流動資産			
現金・預金		4,017,996	
有価証券		11,897,460	
支払委託金		25	
前払費用		2,681	
未収委託者報酬		1,795,741	
未収運用受託報酬		1,411,305	
未収収益		229,350	
立替金		65,962	
繰延税金資産		906,196	
流動資産計		20,326,721	79.6
固定資産			
投資その他の資産			
投資有価証券		3,950,673	
長期差入保証金		10,000	
繰延税金資産		1,245,484	
投資その他の資産計		5,206,158	
固定資産計		5,206,158	20.4
資産合計		25,532,880	100.0

区分	注記 番号	第19期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
		金額	構成比
(負債の部)		千円	%
流動負債			
預り金		498	
未払金		579,578	
未払費用		2,956,225	
未払法人税等		1,410,557	
その他	* 1	113,288	
流動負債計		5,060,149	19.8
固定負債			
長期未払費用		4,438,407	
役員退職慰労引当金		174,176	
その他固定負債		650	
固定負債計		4,613,234	18.1
負債合計		9,673,383	37.9

区分	注記 番号	第19期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
		金額	構成比
(純資産の部)			
株主資本			
資本金		490,000	
資本剰余金			
資本準備金		390,000	
資本剰余金合計		390,000	
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		14,607,139	
利益剰余金合計		14,607,139	
株主資本合計		15,487,139	60.7
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		372,357	
評価・換算差額等合計		372,357	
純資産合計		15,859,497	62.1
負債・純資産合計		25,532,880	100.0

(2) 中間損益計算書

区分	注記 番号	第19期中間会計期間 (自 平成25年 4月 1日 至 平成25年 9月30日)	
		金額	百分比
		千円	%
営業収益			
委託者報酬		7,227,277	
運用受託報酬		3,467,808	
その他営業収益		3,097,839	
営業収益計		13,792,926	100.0
営業費用及び一般管理費		11,316,062	82.0
営業利益		2,476,863	18.0
営業外収益	* 1	71,494	0.5
営業外費用	* 2	126,262	0.9
経常利益		2,422,094	17.6
税引前中間純利益		2,422,094	17.6
法人税、住民税及び事業税		1,387,345	10.1
法人税等調整額		348,283	2.5
中間純利益		1,383,032	10.0

重要な会計方針

項目	第19期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの</p> <p>時価をもって中間貸借対照表価額とし、取得原価（移動平均法による原価法）ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入する方法によっております。</p> <p>時価のないもの</p> <p>移動平均法による原価法によっております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 役員退職慰労引当金</p> <p>役員退職慰労金の支出に備えて、当社内規に基づく当中間会計期間未要支給見積額を計上しております。</p> <p>(2) 貸倒引当金</p> <p>貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(3) 金融商品取引責任準備金</p> <p>金融商品取引事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の5第1項に基づく責任準備金を計上しております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法</p> <p>役員及び従業員に付与されております、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬については、企業会計基準第8号「ストック・オプション等に関する会計基準」及び企業会計基準適用指針第11号「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」に準じて、権利付与日公正価値及び付与された株数に基づき計算される費用を権利確定計算期間にわたり人件費（営業費用及び一般管理費）として処理しております。また、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクおよびゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社との契約に基づき当社が負担する、権利付与日以降の株価の変動により発生する損益については営業外損益として処理しております。</p> <p>(2) 消費税等の会計処理</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第19期中間会計期間末 (平成25年9月30日)
* 1 消費税等の取扱い	控除対象の仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債の「その他」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

項目	第19期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
* 1 営業外収益のうち主要なもの	有価証券分配金	62,253千円
	受取利息	8,389千円
* 2 営業外費用のうち主要なもの	株式従業員報酬	103,912千円
	為替差損	22,350千円

（リース取引関係）

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
注記すべきリース取引を行っていないため、該当事項はありません。

（金融商品関係）

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日現在における中間貸借対照表計上額、中間貸借対照表日における時価及びその差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	4,017,996	4,017,996	-
有価証券			
その他有価証券	11,897,460	11,897,460	-
未収委託者報酬	1,795,741	1,795,741	-
未収運用受託報酬	1,411,305	1,411,305	-
投資有価証券			
その他有価証券	3,950,673	3,950,673	-

金融商品の時価の算定方法

投資有価証券以外の上記金融資産については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

投資有価証券につきましては、投資信託のため、直近の基準価額によっております。

（有価証券関係）

第19期中間会計期間末（平成25年9月30日）

その他有価証券で時価のあるもの

（単位：千円）

区分	種類	取得原価	中間貸借対照表計上額	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,310,000	3,910,673	600,673
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	40,000	40,000	-
	コマーシャル・ペーパー	11,897,460	11,897,460	-

（デリバティブ取引関係）

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

〔セグメント情報〕

当社の報告セグメントは、投資運用業者として単一であるため、該当事項はありません。

〔関連情報〕

1．製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ ファンド関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	7,227,277	3,467,808	3,097,839	13,792,926

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
12,228,537	1,564,389	13,792,926

海外の外部顧客からの収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める地域はありません。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、該当事項はありません。

（ 1株当たり情報 ）

第19期中間会計期間 (自 平成25年 4月 1日 至 平成25年 9月30日)	
1株当たり純資産額	2,478,046円41銭
1株当たり中間純利益金額	216,098円84銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権付社債等潜在株式がないため記載していません。	
（ 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎 ）	
中間損益計算書上の中間純利益	1,383,032千円
1株当たり中間純利益金額の算定に用いられた普通株式に係る中間純利益	1,383,032千円
差 額	- 千円
期中平均株式数	
普通株式	6,400株

（ 重要な後発事象 ）

第19期中間会計期間（自平成25年 4月 1日 至平成25年 9月30日）

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月15日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているゴールドマン・サックス・世界債券オープンA 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）の平成25年6月8日から平成25年12月7日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）の平成25年12月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月8日から平成25年12月7日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注1）上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月15日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているゴールドマン・サックス・世界債券オープンB 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）の平成25年6月8日から平成25年12月7日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）の平成25年12月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月8日から平成25年12月7日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注1）上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月5日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第18期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

() 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月3日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第19期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。